

收盘日评 银行间票据业务

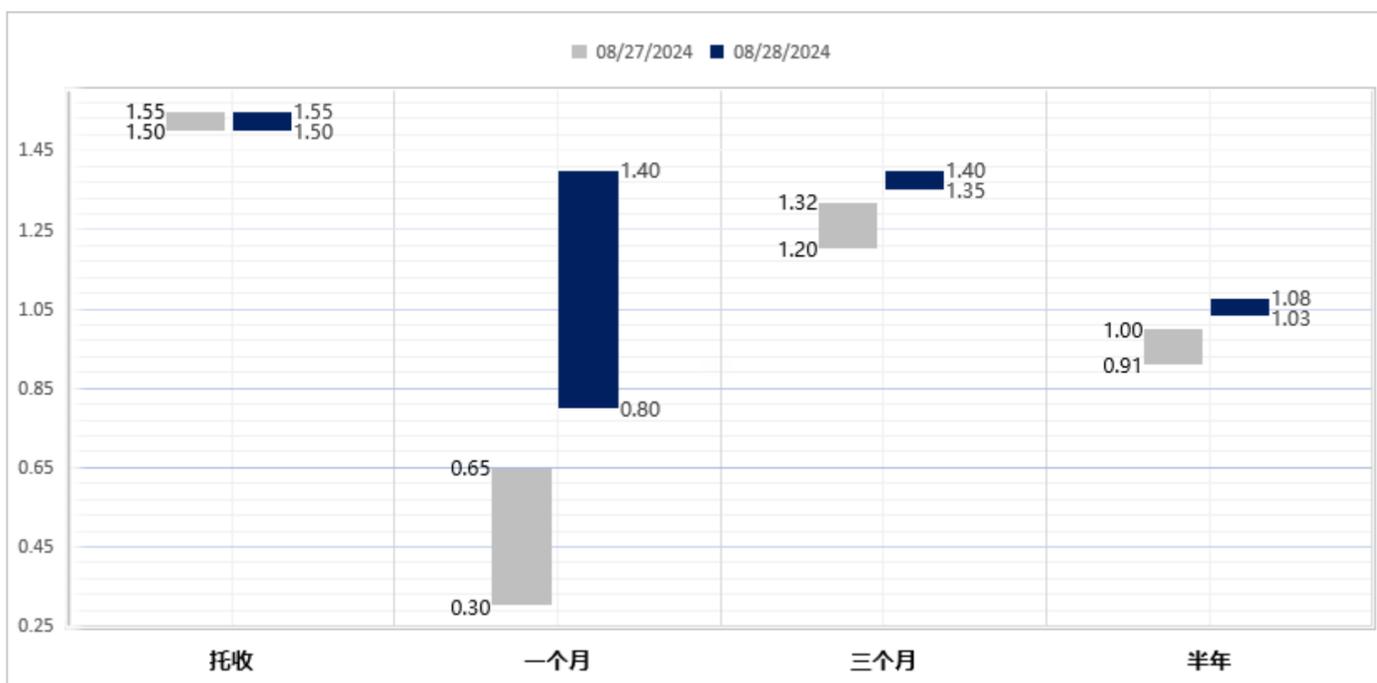
常规报告系列



【2024-08-28】

今日央行开展 2773 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2580 亿，全口径资金净投放 193 亿。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格下行。本交易日票据转贴现市场交投依旧活跃，由于承兑及直贴数据向好，年内及跨年供给充裕，利率较昨日有较大幅度上行，午盘过后利率启稳，跨年 1 月则有小幅回调。

价格方面，托收报价区间维持在 1.50%~1.55% 之间。9 月国股方面，本交易日利率回升幅度较大，月初到期票位于 0.5%~0.7% 左右，整体位于 0.50%~1.4% 区间。四季度方面，10~11 月报价位于 1.35%~1.42%，12 月到期国股活跃度较高，市场整体报价区间在 1.35%~1.37% 左右。跨年到期票方面，1 月国股早盘受市场影响继续走高，但市场明显更偏向 1 月到期票据，午盘后利率回调 3bp 左右，全天报价区间在 0.80%~0.87%；2 月国股早间开盘位于 1.03%~1.05% 左右，随着主流机构入场收票，利率稳定在 1.07% 位置，全天报价区间位于 1.03%~1.08%。



Thanks & Best Regards

联系人: Elaine Zhu
邮箱: Elaine.Zhu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所念及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和/或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN