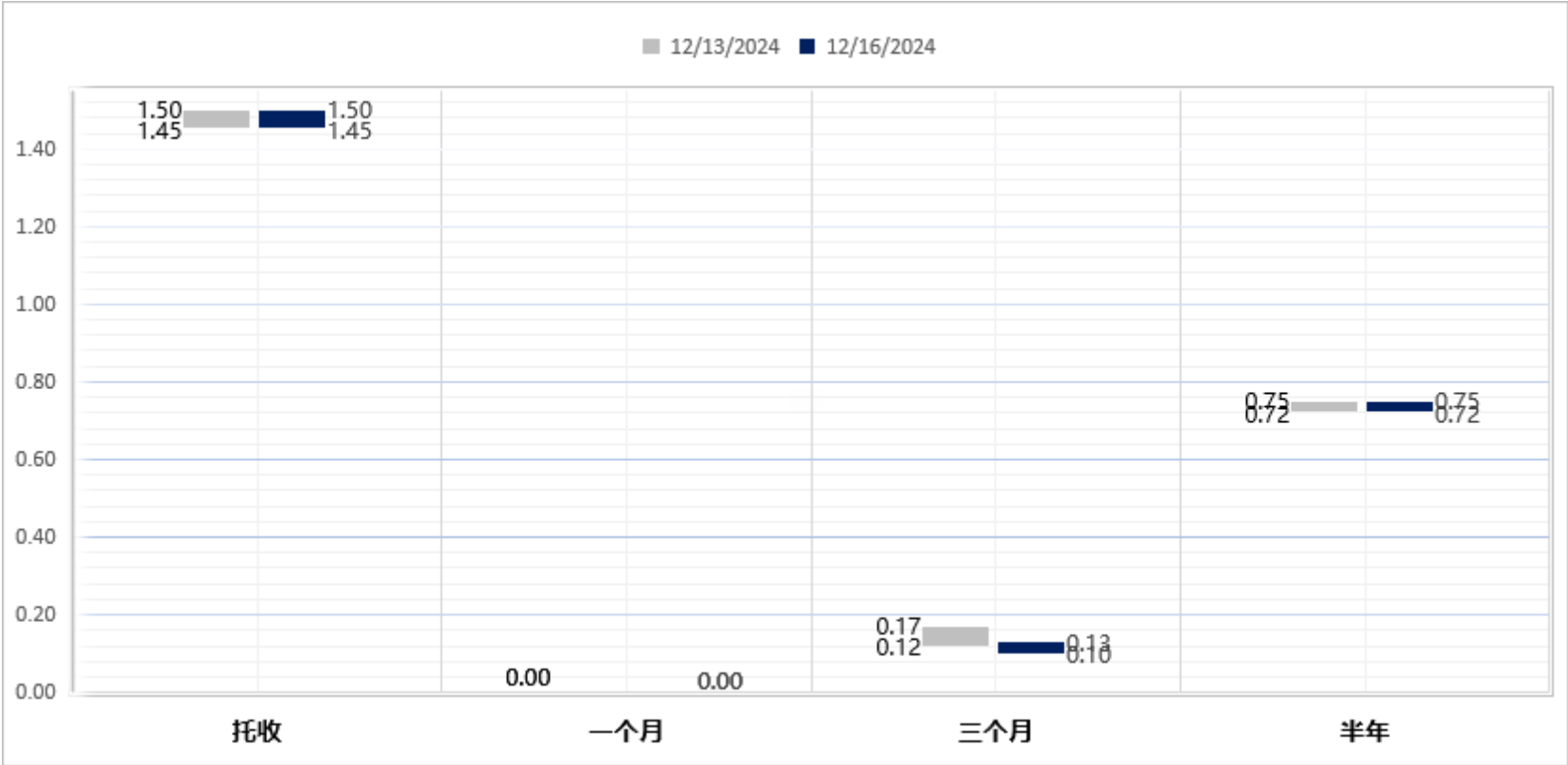




【2024-12-16】

今日央行开展 7531 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 471 亿，逆回购口径资金净投放 7060 亿，此外 MLF 到期 14500 亿，国库现金定存到期 1200 亿。今日资金面日内紧张，短期限资金价格上行。今日票据转贴现市场交投活跃，一季度到期票据依旧紧俏，利率较上周五下行 5bp 左右。二季度到期票早盘受市场主流机构降价收票影响，利率继续回调，但市场需求有限，供给较为充足，6M 双国于 0.73%附近企稳横盘，尾盘小幅回升 1bp 左右。

托收方面，全天报价区间多在 1.45%~1.50%附近。一季度方面，1 月到期一票难求，始终维持在低利率区间，整体报价在 0.0001%附近；2 月双国全天报价区间多在 0.05%~0.08%；3 月双国全天报价区间多在 0.10%~0.13%。二季度方面，4 月双国全天报价区间多在 0.71%~0.74%；5 月双国全天报价区间多在 0.81%~0.83%，6 月国股全天报价区间多在 0.72%~0.75%。



Thanks & Best Regards

王成 Ivan

专家经纪人 Expert Broker | 票据市场部 Commercial Paper Market