

收盘日评 银行间票据业务

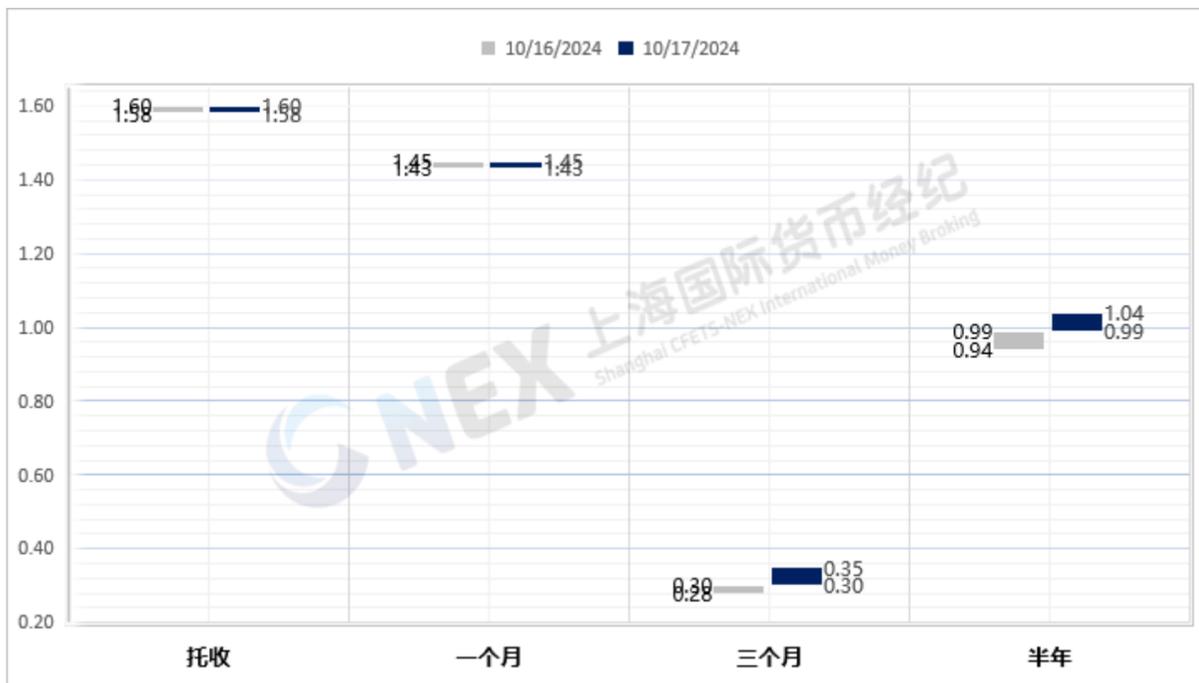
常规报告系列



【2024-10-17】

今日央行开展 1326 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1500 亿，资金净回笼 174 亿，此外有 700 亿国库现金定存到期。今日资金面整体均衡稍松，短期限资金价格下行。本交易日票据转贴现市场交投尚可，早盘主流机构依旧维持市场买方主力，报价上调带动跨年各期限利率呈现不同幅度上扬。午后买方力量减弱，卖方上调报价动力不足，市场交投转冷至收盘，利率横盘调整。

托收国股方面，全天报价区间多在 1.58%~1.60%。年内国股方面，日内价格较昨日基本持平，11 月国股全天报价区间多在 1.43%~1.45%。12 月国股全天报价区间多在 1.36%~1.38%。跨年国股方面，1 月国股较昨日上探 5BP，全天报价区间多在 0.30%~0.35%。2 月国股较昨日上探 2BP，全天报价区间多在 0.85%~0.87%。3 月国股较昨日上探 2BP，全天报价区间多在 0.76%~0.78%。4 月国股较昨日上探 5BP，全天报价区间多在 0.99%~1.04%。



文：Amber Zhang

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