

收盘日评 银行间票据业务

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-12-09】

今日央行开展 471 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 333 亿，逆回购口径资金净投放 138 亿。今日资金面日内持续均衡偏紧。今日资金面日内紧张，尾盘边际稍有改善，短期限资金价格上行。本交易日票据转贴现市场交投相对活跃，短端供给不足，长端需求略显疲软，利率不同程度回调。二季度票供给充足，收票集中于主流机构，买盘大多持观望态度，利率全天上行。

托收方面，全天报价区间多在 1.43%~1.45%。跨年国股方面，1 月票一票难求，始终维持在低利率区间，整体报价在 0.0001%附近；2 月国股利率维持在 0.1%左右，市场全天报价区间在 0.08%~0.13%；3 月国股市场全天报价区间在 0.15%~0.18%。二季度方面，4 月国股全天报价区间在 0.71%~0.73%；5 月国股全天报价区间位于 0.88%~0.92%，6 月国股全天报价区间多在 0.72%~0.76%。

