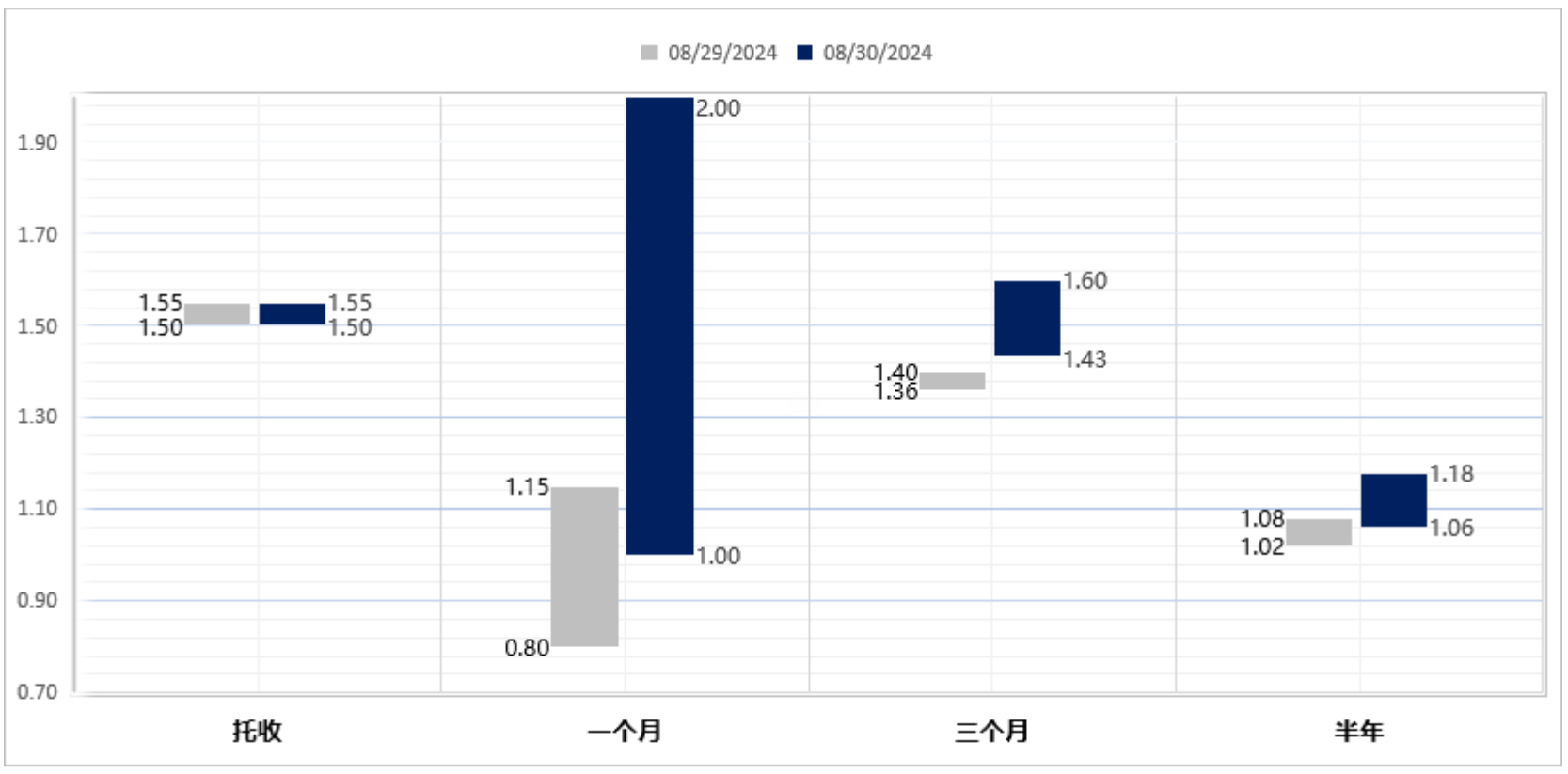
【2024-08-30】

今日央行开展 301 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3793 亿，全口径资金净回笼 3492 亿。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格小幅上行。本交易日为 8 月最后一个交易日，各机构需求以平规模为主，票据转贴现市场各期限波动较大。年内利率涨幅较大，跨年期限利率早盘上冲之后迅速回调。

价格方面，9 月国股本交易日利率上行，月初到期票位于 1.00%~1.40%左右，月末期限价格区间位于 1.50%~1.80%，整体位于 1.00%~2.00%区间。四季度方面，10~11 月报价位于 1.43%~1.60%，12 月到期国股买盘需求旺盛，市场整体报价区间在 1.40%~1.60%左右。跨年到期票方面，1 月国股早盘报价位于 0.78%~1.02%左右，随着买盘增多及主流机构入场收票，利率回调至 0.85%~0.88%左右，全天报价区间在 0.85%~1.02%；2 月国股开盘位于 1.06%~1.10%，最后利率上探至 1.18%左右，随着需求不断涌现，利率又回调 2~3bp，全天报价区间位于 1.06%~1.18%。



Thanks & Best Regards

王成 Ivan

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