

收盘日评 银行间票据业务

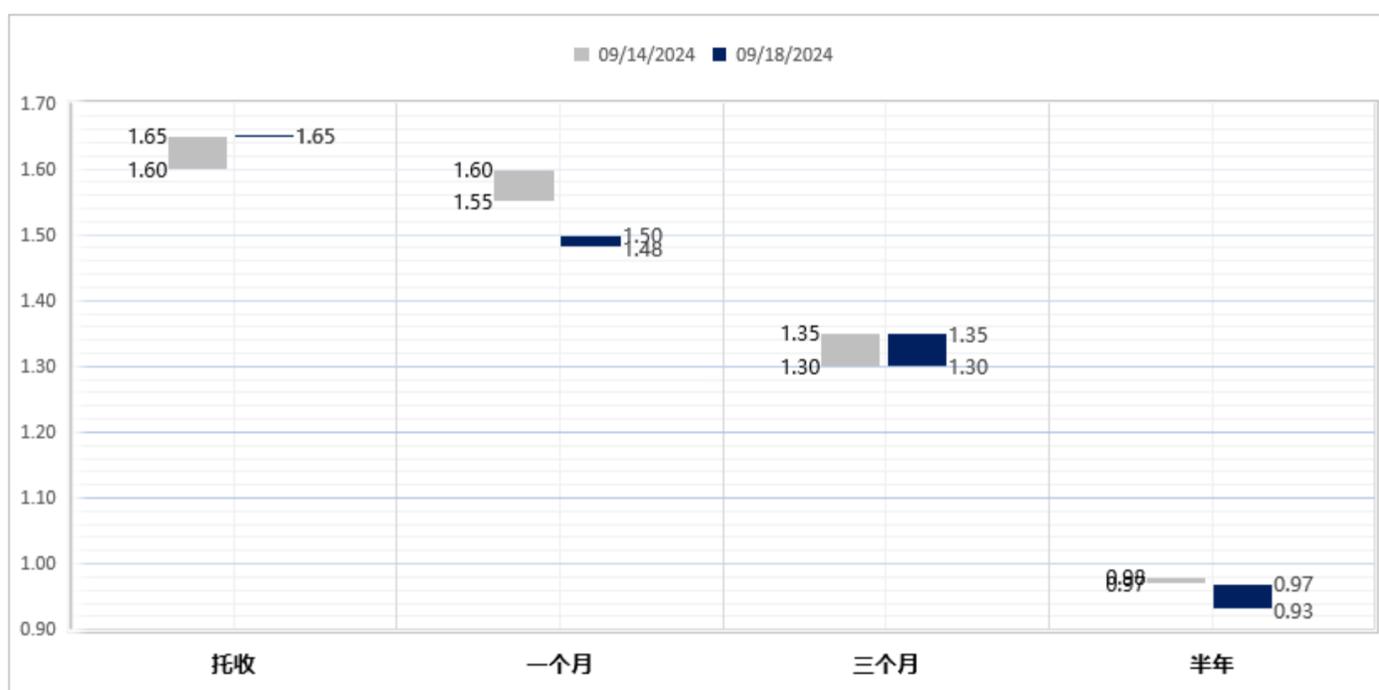
常规报告系列



【2024-09-18】

今日央行开展 5682 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4875 亿，MLF 到期 5910 亿，全口径资金净回笼 5103 亿。今日资金面总体偏紧。今日票据转贴现市场交投较为活跃，早盘大行报价较早，市场成交价已偏低于行报价成交，整体收出均衡各期限成交活跃，随着大行降价抢量各期限卖盘开始压价出票，跨年 1 月和 3 月价格降幅较多，年内票由于买盘较少未见明显波动。午盘以后买入需求依旧较多，成交价格整体震荡微跌。

托收双国股成交利率集中于 1.65%，全天报价区间为 1.60%~1.65%。四季度国股方面，10 月国股全天报价区间位于 1.55%~1.57%，11 月国股全天报价区间位于 1.45%~1.50%，12 月国股全天报价区间位于 1.30%~1.34%。跨年国股方面，1 月国股全天报价区间多在 0.66%~0.70%，2 月国股全天报价区间多在 0.98%~1.00%，3 月国股利率全天报价区间多在 0.93%~0.97%。



文：Liushun Yao

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