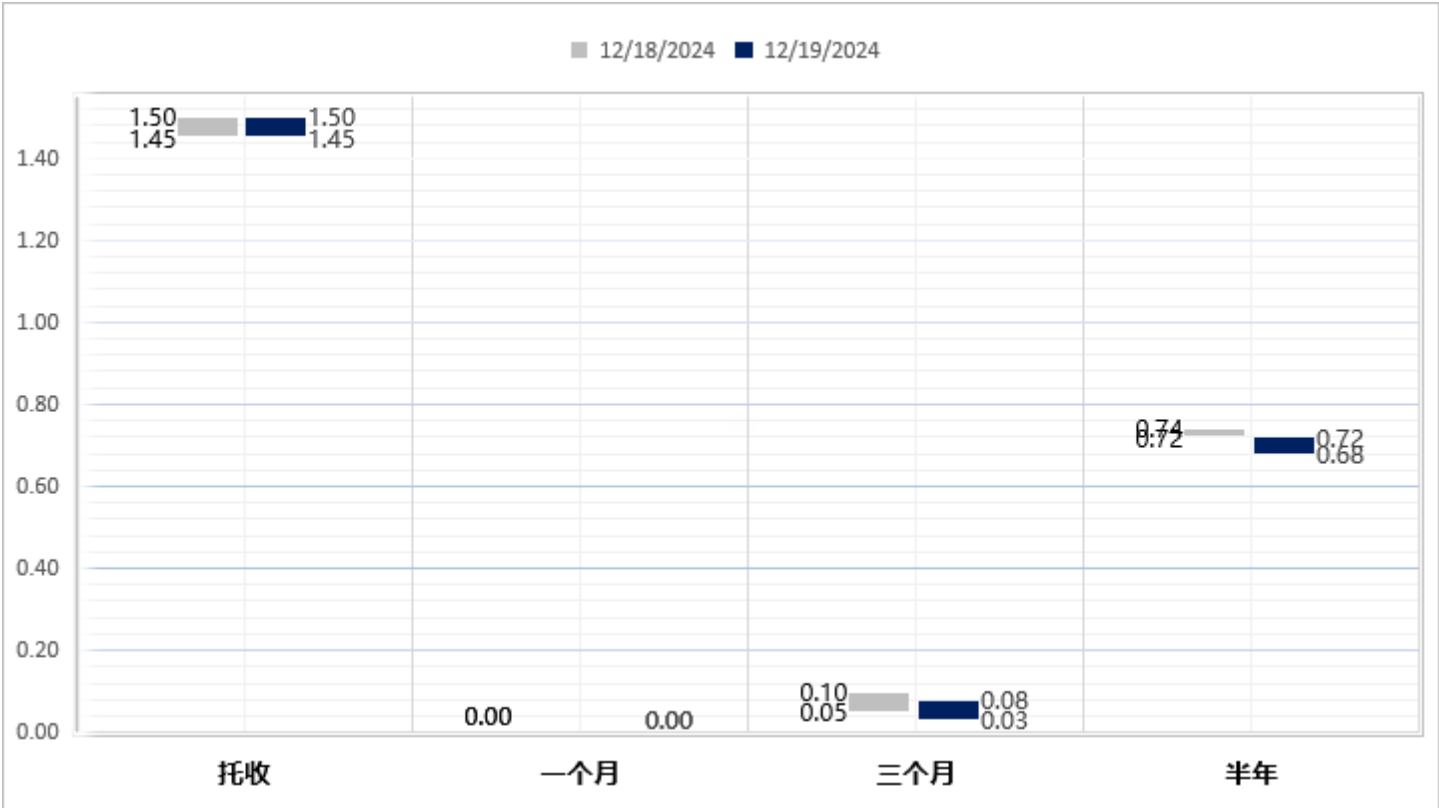




【2024-12-19】

今日央行开展 806 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 661 亿，逆回购口径资金净投放 145 亿。今日资金面整体均衡偏松，短期限资金价格下行。今日票据各期限利率均呈现下行态势，6M 双国尾盘收于 0.68%，一季度票供不应求，利率全线逼近 0.01%，二季度价格受一季度买卖双边力量影响，虽票源较为充足，依旧下行约 3BP 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 月双国全天报价多稳定在 0.01% 附近；3 月双国全天报价区间多在 0.03%~0.08%。二季度方面，4 月双国全天报价区间多在 0.70%~0.73%；5 月双国全天报价区间多在 0.79%~0.82%，6 月双国全天报价区间多在 0.68%~0.72%。



Thanks & Best Regards

张茜 Amber

资深经纪人 Chief Broker | 票据 Commercial Paper

上海市杨浦区荆州路 27 号 (200082)
27 Jingzhou Road, Yangpu District, Shanghai (200082)
Phone: 86-21-68983775 | Mobile: 86-18817605291 | Fax: 86-21-50472092 | Email: Amber.zhang@cfets-nex.com.cn
Website: www.cfets-nex.com.cn

