

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

【2024-12-27】

今日央行开展 1078 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1016 亿，逆回购口径资金净投放 62 亿。今日资金面整体均衡偏松，隔夜期限资金价格下行。今日票据转贴市场整体供给充足，市场有大量清单，主流机构停收，规模压降明显，市场各期限供给充足，除部分中小机构外，买盘难询，利率一路上行。一季度二三月票涨至 1.0% 附近，涨幅接近 100bp。二季度国股突破 1.0%，其中六月双国尾盘涨至 1.25% 附近。

托收方面，全天报价区间多在 1.44%~1.45% 附近。一季度方面，供给稍有好转。1 月全天报价在 0.001%~0.01% 附近；2 月双国在 0.10%~1.05%；3 月双国全天报价区间多在 0.10%~1.05%。二季度方面，4 月双国全天报价区间多在 0.90%~1.20%；5 月双国全天报价区间多在 0.90%~1.20%，6 月双国全天报价区间多在 0.90%~1.25%。

