

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-06-25】

财经新闻

- (1) **今年前五月财政收入同比降 2.8%，财政支出增 3.4%。**6 月 24 日周一，财政部公布财政数据显示，2024 年 1-5 月，全国一般公共预算收入 96912 亿元，同比下降 2.8%，全国一般公共预算支出 108359 亿元，同比增长 3.4%。1-5 月，国内增值税收入同比下降 6.1%，国内消费税收入同比增长 7.2%，企业所得税收入同比下降 1.7%，个人所得税收入同比下降 6%。
- (2) **7 天 40 家银行被吸收合并，农村中小银行"减员"再加速。**据券商中国记者统计，往前追溯该批复发布的前一周，已有 40 家农村中小银行被吸收合并或解散，该趋势也展现农村中小银行缩编步伐的加快。除前述村镇银行外，辽宁农村商业银行获批吸收合并 36 家农村中小银行机构；民生银行收购 1 家村镇银行并设立分支机构；东莞农村商业银行吸收合并 2 家村镇银行。业内人士表示，这意味着今年农村中小银行收购、兼并、退出的速度进一步加快。相关人士预测，到 2024 末，银行业金融机构独立法人名单将进一步缩水。“其中，中小农商行、村镇银行仍会占大部分。”
- (3) **媒体：美联储考虑修改去年提出的银行监管新规方案，大幅降低银行资本金要求。**知情人士透露，美联储向其他美国监管机构出示了一份长达三页的文件，以阐述对银行资本改革方案的潜在改动。这番调整将显著减轻华尔街银行的负担。据悉，相关修订将撤销这项具有里程碑意义的提案的关键部分，其中包括一项可能会对拥有大量交易业务的大银行产生显著影响的内容。在大型银行必须持有多少额外资本以作为缓冲抵御金融冲击方面，美联储的文件并没有提供最新的预估。不过上述人士表示，早期的计算表明，拟议的变化可能使得增幅低至 5%。最初的版本则要求资本金整体提高 16%。
- (4) **美国 CFTC：黄金看涨情绪创一个月新高。**美国商品期货交易委员会（CFTC）数据显示，6 月 18 日当周，投机者所持 COMEX 黄金净多头头寸增加 11,984 手合约，至 189,533 手合约，创一个月新高。

市场动态

- (1) 周一央行开展 500 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 40 亿，全口径资金净投放 460 亿。今日逆回购到期 860 亿。周一资金面早盘均衡偏紧，日内边际改善，尾盘均衡偏松。
- (2) 周一国债期货主力合约全线收涨，现券收益率震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.055，较上个交易日上涨 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.820，较上个交易日上涨 0.09%。剩余期限 9.54 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3415%/2.3410%，剩余期限 9.67 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2625%/2.2615%。
- (3) 据中国外汇交易中心数据显示，上个交易日夜盘在岸人民币兑美元（CNY）收报 7.2598，较前一交易日夜盘收涨 11 个基点，成交量 255.92 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 建设银行 CD214 等同业存单共 142 只，计划发行规模 2575.20 亿；24 国开 10(增 15)等金融债共 10 只，计划发行规模 399.00 亿；24 豫水利 MTN002 等中期票据共 26 只，计划发行规模 223.38 亿；24 电网 CP008 等短期融资券共 26 只，计划发行规模 335.00 亿；24 九联投资 PPN001 等定向工具共 2 只，计划发行规模 11.26 亿；24 加拿大银行债 01BC 国际机构债共 1 只，计划发行规模 25.00 亿；24 农盈利信远弘 2 优先等资产支持证券共 18 只，计划发行规模 63.35 亿。共计 225 只债券发行，计划发行规模 3632.19 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu