

市场概述 晨报

常规报告系列

 **NEX** 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2023-07-04】

财经新闻

(1) **接近外汇局人士：6月外资净买入境内债券延续前几个月的较高规模。**据界面从接近外汇局人士处获悉，今年以来境外投资者持有人民币债券情况持续向好，6月外资净买入境内债券延续前几个月的较高规模。前述人士表示，这显示出在国际金融市场延续波动走势的背景下，人民币债券的长期投资价值凸显。未来，随着我国各项政策举措不断发挥效应，经济运行持续回升向好，人民币资产将持续具有吸引力。

(2) **6月新发债基份额占比大增。**据中证报，上半年，公募基金发行角逐告一段落。数据显示，在刚刚结束的6月份，债基俨然成为市场吸金主力，6月新成立的债基总发行份额占比创今年以来月度新高，更有存量混基宣布转型为债基，不少债基近期纷纷暂停大额申购。

(3) 险资运用余额超 26 万亿元，债券投资占比逼近历史高点。国家金融监督管理总局近日发布的数据显示，截至今年 5 月末，保险资金运用余额达到 26.35 万亿元，较去年末增长 5.18%。其中，债券投资 11.32 万亿元，占比 42.95%，与 2013 年高点 43.42% 非常接近。债券投资一直是保险资金投资的定海神针，占比在 2013 年曾经高达 43.42%，此后随着投资渠道放开，债券投资占比一路下滑，至 2015 年末，占比降至 32.15%。此后 3 年一直在 34.5% 左右徘徊。不过，自 2019 年起，债券投资占比逐年提升。

(4) 美国 6 月 ISM 制造业意外创三年多新低，连续八个月萎缩。周一，ISM 公布的数据显示，受生产、就业和投入价格回落的拖累，美国 6 月 ISM 制造业指数连续八个月陷入萎缩，并创下 2020 年 5 月以来新低，持续低于 50 荣枯分水岭的时间创 2008-2009 年以来最长。



市场动态

(1) 周一央行开展 50 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4400 亿，资金净回笼 4350 亿。今日逆回购到期 2190 亿元。周一资金面总体均衡，午后一度有所收紧。

(2) 周一国债期货弱势震荡，现券收益率小幅上行。10 年期国债期货主力合约 T2309 收报 101.880，较上个交易日下跌 0.08%；5 年期国债期货主力合约 TF2309 收报 102.100，较上个交易日下跌 0.06%。截至目前，剩余期限 9.68 年的国开债活跃券 230205 收益率报 2.8350%/2.8330%。

(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 7.2450，较前一交易日夜盘收涨 60 个基点。成交量 320.39 亿美元，较前一交易日减少 67.17 亿美元。



一级市场

今日银行间市场有 23 宁夏债 10 地方政府债共 1 只, 计划发行规模 45.97 亿; 23 平安银行 CD102 等同业存单共 74 只, 计划发行规模 596.20 亿; 23 国开 08(增 6)等金融债共 7 只, 计划发行规模 313.00 亿; 23 德安专项债 01 等企业债共 3 只, 计划发行规模 14.80 亿; 23 国联 MTN004 等中期票据共 7 只, 计划发行规模 46.00 亿; 23 宁沪高 SCP017 等短期融资券共 15 只, 计划发行规模 98.80 亿; 23 融腾 4A1_bc 等资产支持证券共 4 只, 计划发行规模 100.00 亿。共计 111 只债券发行, 计划发行规模 1213.77 亿。



评级动态

桂林银行股份有限公司主体评级由“ AA+ ”上调至“ AAA ”（中诚信国际）。

以上仅供参考, 谢谢!

文/Ellen Liu

如果您对本文有任何评论与见解
请发邮箱至: SHOffice@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松查看更多资讯



免责声明:

文中信息均来自公开资料。上海国际货币经纪有限责任公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证。内容和意见仅供参考, 本文仅反映作者个人观点, 并不代表公司的看法。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN