

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-06-24】

财经新闻

(1) **央行金融市场司：继续完善“债券通”“互换通”等安排，丰富利率汇率等衍生工具。**央行金融市场司党支部发布文章《坚定不移推进债券市场高水平对外开放 助力加快建设金融强国》称，下一步，中国人民银行将以制度型开放为重点，统筹好开放和安全，持续推进债券市场高水平对外开放。深化拓展金融市场互联互通。继续完善“债券通”“互换通”等安排，丰富利率汇率等衍生工具，为境外投资者配置人民币资产、开展流动性管理提供便利。探索建立将人民币债券作为离岸合格担保品的机制。

(2) **商务部：实际使用外资规模仍处于历史高位，金额有所下降主要是受去年高基数影响。**商务部外资司负责人介绍 2024 年 1-5 月全国吸收外资情况：1-5 月，我国新设立外商投资企业 21764 家，同比增长 17.4%，延续了去年以来新设企业较快增长的态势；实际使用外资规模仍处于历史高位，金额有所下降主要是受去年高基数影响。特别是，1-5 月，我国制造业实际使用外资 1171 亿元，其中高技术制造业引资 504.1 亿元，占全国引资比重较上年同期分别提升了 2.8 个和 2.7 个百分点，显示出我国引资结构持续优化。此外，国家统计局数据显示，今年 1-4 月外资规上工业企业利润总额增长 16.7%，高于全国平均水平（4.3%），经营状况持续改善。

(3) **美国 6 月 Markit 综合 PMI 创两年多新高，制造业再扩张，通胀压力降温。**6 月 21 日周五，标普全球公布的数据显示，美国 6 月 Markit PMI 初值数据全线好于预期，服务业活动小幅回升，达到两年多以来的最快增速，表明随着第二季度接近尾声，整体商业活动显示出韧性。同时，由于价格压力降温 and 借贷成本降低的前景，展望有所改善。

(4) **日元 160 关口岌岌可危，日本政府强硬表态“如有必要，将全天 24 小时干预市场”。**周一，日元兑美元汇率继续走弱，逼近 160 关口，这一水平被视为日本当局可能再次出手干预外汇市场的重要节点。面对持续贬值的压力，日本外汇事务最高官员神田真人周一早间发出强硬警告，表示日本政府随时准备全天 24 小时干预汇市。

市场动态

(1) 上周五央行开展 100 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，资金净投放 80 亿。今日逆回购到期 40 亿。上周五资金面早盘紧张，午后明显改善，尾盘均衡偏松。

(2) 上周五国债期货主力合约多数收跌，现券收益率整体小幅上行；10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.910，较上个交易日下跌 0.10%。剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3675%/2.3640%，剩余期限 9.68 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2860%/2.2850%。

(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 7.2609，较前一交易日夜盘收跌 5 个基点。成交量 293.44 亿美元，较前一交易日减少 15.20 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 附息国债 13 等国债共 2 只，计划发行规模 2900.00 亿；24 山东债 29 等地方政府债共 4 只，计划发行规模 215.08 亿；24 民生银行 CD257 等同业存单共 109 只，计划发行规模 1439.20 亿；24 农发 03(增 13)等金融债共 7 只，计划发行规模 246.00 亿；24 水发集团 MTN006 等中期票据共 35 只，计划发行规模 540.10 亿；24 华媒 SCP002 等短期融资券共 19 只，计划发行规模 258.68 亿；24 渝惠通 PPN001 定向工具共 1 只，计划发行规模 3.00 亿；24 保利邦鑫 ABN002 优先等资产支持证券共 15 只，计划发行规模 39.24 亿。共计 192 只债券发行，计划发行规模 5641.60 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu