

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

【2023-10-27】

财经新闻

(1) **险资配置债券占比创近 10 年新高。**据证券日报，10 月 25 日，国家金融监督管理总局披露的数据显示，截至 9 月末，险资运用余额升至 27.18 万亿元。从配置的大类资产来看，债券为 11.95 万亿元，占比 43.99%；股票和证券投资基金为 3.48 万亿元，占比 12.82%；银行存款为 2.75 万亿元，占比 10.11%；其他投资为 8.99 万亿元，占比 33.08%。值得一提的是，9 月末，险资对债券的投资余额占比创近 10 年新高。

(2) **美国三季度实际 GDP 初值增长 4.9% 高于预期，创近两年来最快增速。**周四，美国商务部发布的数据显示，美国第三季度实际 GDP 年化季环比初值按年增长 4.9%，增幅是上季度 2.1% 的两倍多，超出市场预期的 4.7%。同时发布的季度通胀数据 PCE 指数有所降温，个人消费支出（PCE）价格指数同比上涨 2.9%，去年同期涨幅为 2.5%；不含食品和能源的核心 PCE 价格指数增长 2.4%，较前值 3.7% 显著放缓，略微低于经济学家预期 2.5%。

(3) 美国 9 月耐用品订单环比增长 4.7% 高于预期，为三年多来最快增速。10 月 26 日，美国商务部公布的数据显示，美国 9 月耐用品订单环比初值上升 4.8%，好于预期的 1.8%，前值从 0.1% 下修为 -0.1%，为自 2020 年 7 月以来最大的环比涨幅。扣除飞机非国防资本耐用品的核心资本货物订单环比增长 0.6%，好于预期的 0%，低于前值的 0.9%。

(4) 欧央行如期暂停加息。10 月 26 日，欧洲央行公布最新利率决议，维持欧央行三大主要利率不变，将主要再融资利率、存款便利利率、边际贷款利率维持在 4.5%，4% 以及 4.75% 的历史高位。去年 7 月结束长达八年的负利率时代以来，欧洲央行已连续 10 次加息，累计加息 450 个基点，为有史以来最快的紧缩步伐。



市场动态

(1) 周四央行开展 4240 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3440 亿，资金净投放 800 亿。今日逆回购到期 8280 亿元。周四资金面整体偏松，隔夜期限资金价格明显下行。

(2) 周四国债期货主力合约全线小幅收跌，现券收益率长端震荡上行，短端小幅下行。10 年期国债期货主力合约 T2312 收报 101.670，较上个交易日下跌 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2312 收报 101.815，较上个交易日下跌 0.01%。截至目前，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 230210 收益率报 2.7850%/2.7800%。

(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 7.3158，较前一交易日夜盘收涨 7 个基点。成交量 171.83 亿美元，较前一交易日增加 39.38 亿美元。



一级市场

今日银行间市场有 23 贴现国债 66 等国债共 2 只, 计划发行规模 1900.00 亿; 23 山东债 89 等地方政府债共 14 只, 计划发行规模 800.36 亿; 23 平安银行 CD144 等同业存单共 159 只, 计划发行规模 2492.70 亿; 22 进出 05(增 18)等金融债共 7 只, 计划发行规模 600.00 亿; 23 深圳地铁 MTN006 等中期票据共 12 只, 计划发行规模 80.40 亿; 23 天津轨交 SCP019 等短期融资券共 22 只, 计划发行规模 170.20 亿; 23 加拿大银行债 01 国际机构债共 1 只, 计划发行规模 10 亿。共计 217 只债券发行, 计划发行规模 6053.66 亿。



评级动态

无。

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