

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-08-16】

财经新闻

- (1) **央行行长潘功胜：央行将继续坚持支持性的货币政策立场，加强逆周期和跨周期调节。** 中国人民银行党委书记、行长潘功胜表示，中国人民银行将继续坚持支持性的货币政策立场，加强逆周期和跨周期调节，支持巩固和增强经济回升向好态势。进一步提升货币政策对促进经济结构调整、转型升级、新旧动能转换的效能，引导金融机构加大对重点领域、薄弱环节的信贷支持力度，更有针对性地满足合理的消费融资需求。
- (2) **媒体：监管层近期限制部分公募机构旗下纯债基金配置 7 年期国债。** 据经济观察网，7 月以来，债市持续走牛，10 年期国债到期收益率一度到达了 2.1% 的低位，市场做多情绪强烈。在此情况下，监管层出手、加强对债市交易行为的引导与监管。近期，监管层对部分公募机构进行窗口指导，限制部分公司旗下纯债基金配置 7 年期国债。
- (3) **美国 7 月零售销售环比 1%超预期，创一年半来最高。** 8 月 15 日，美国人口调查局公布数据显示，美国 7 月零售销售环比增长 1%，为 2023 年 2 月以来最高水平，远超过预期 0.4%，前值从 0% 下修至 -0.2%。
- (4) **美国上周首次申请救济金人数 22.7 万人，创 7 月以来最低。** 8 月 15 日，美国劳工统计局公布数据显示，美国 8 月 10 日当周首次申请失业救济人数 22.7 万人，为五周以来最低水平，低于预期 23.5 万人，低于前值 23.3 万人。在未经季节性调整的基础上，首次申领失业救济人数基本处于数十年来的最低水平。

市场动态

- (1) 周四央行开展 5777 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 71 亿，MLF 到期 4010 亿，全口径资金净投放 1696 亿。今日逆回购到期 129 亿元。周四资金面整体均衡附近波动。
- (2) 周四国债期货主力合约全线收跌，现券收益率午后上行。10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.545，较上个交易日下跌 0.16%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.250，较上个交易日下跌 0.14%。剩余期限 9.72 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2350%/2.2330%，剩余期限 9.78 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1860%/2.1855%。
- (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 7.1754，较前一交易日夜盘收跌 354 个基点，成交量 363.04 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 贴现国债 48 国债共 1 只，计划发行规模 300.00 亿；24 四川 35 等地方政府债共 10 只，计划发行规模 351.69 亿；24 交通银行 CD265 等同业存单共 85 只，计划发行规模 895.20 亿；24 进出 02(增 12)等金融债共 4 只，计划发行规模 300.00 亿；24 大唐集 MTN008 等中期票据共 28 只，计划发行规模 286.93 亿；24 华能新能 SCP001 等短期融资券共 8 只，计划发行规模 82.50 亿。共计 136 只债券发行，计划发行规模 2216.32 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu