

市场概述
晨报

常规报告系列



【2024-10-21】

财经新闻

- (1) **中银协报告：2024 年存款定期化趋缓，去年存款增量 97%来自定存。** 10 月 19 日，中国银行业协会在 2024 金融街论坛年会上发布的《2024 年度中国银行业发展报告》显示，2023 年，国内银行业存款定期化程度加深，存款增量 97%来自定期存款，成本刚性特征明显；2024 年上半年，金融机构定期存款增速趋缓。
- (2) **美国政府 2024 财年赤字突破 1.8 万亿，债务利息支出首超万亿。** 美东时间 10 月 18 日周五，美国财政部公布，截至 2024 年 9 月 30 日的 2024 财年，美国联邦政府的财政赤字达到 1.833 万亿美元，为有纪录以来第三高，仅次于新冠疫情期间 2020 财年的 3.132 万亿美元和 2021 年财年的 2.772 万亿美元。2024 财年，政府的债务利息支出同比增加 2540 亿美元，增长 29%至 1.1 万亿美元，占 GDP 之比创 1998 年来新高。
- (3) **现货金涨约 1.1%刷新历史高位至 2720 美元上方。** 周五（10 月 18 日）纽约尾盘，现货黄金上涨 1.07%，报 2721.49 美元/盎司，北京时间 04:51 涨至 2722.57 美元创历史新高，全周累计上涨 2.44%。

市场动态

- (1) 上周五央行开展 1084 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 942 亿，资金净投放 142 亿，此外有 900 亿国库现金定存到期。今日逆回购到期 427 亿。上周五资金面整体均衡偏松。
- (2) 上周五国债期货主力合约全线收跌，现券收益率震荡走升。10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.160，较上个交易日下跌 0.15%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.860，较上个交易日下跌 0.10%。剩余期限 9.55 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1950%/2.1925%，剩余期限 9.60 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1150%/2.1100%。
- (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 7.1030，较前一交易日夜盘收涨 205 个基点。成交量 440.94 亿美元，较前一交易日减少 49.40 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 广西债 36 等地方政府债共 3 只，计划发行规模 186.09 亿；24 工商银行 CD129 等同业存单共 133 只，计划发行规模 694.80 亿；24 农发 15(增 5)等金融债共 4 只，计划发行规模 210.00 亿；24 中电投 MTN024B 等中期票据共 27 只，计划发行规模 461.60 亿；24 苏交通 SCP024 等短期融资券共 15 只，计划发行规模 149.90 亿；24 惠安城建 PPN001 定向工具共 1 只，计划发行规模 4.20 亿； 24 大华银行债 01 国际机构债共 1 只，计划发行规模 45.00 亿；24 德宝天元 1A 等资产支持证券共 9 只，计划发行规模 115.00 亿。共计 193 只债券发行，计划发行规模 1866.59 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu