

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-08-30】

财经新闻

- (1) **科创债发行量质双升。**交易所科技创新公司债是债券市场服务科技创新和新质生产力的重要抓手。今年以来，在政策支持等因素影响下，科创债市场快速扩容，发行规模和数量显著增长、发行期限明显拉长、发行结构有所优化，在支持科技创新、助力产业转型升级等方面发挥了积极作用。Wind 数据显示，截至 8 月 27 日，年内科创债发行数量近 300 只，规模达 3600 亿元，同比增长均超 110%
- (2) **超七成中小银行上半年投资收益占比上升。**8 月 29 日，中证报刊文，共有 18 家 A 股上市中小银行发布 2024 年半年度报告。拆解营业收入结构后，超七成中小银行上半年投资收益占当期营业收入比重较去年同期有所上升。不少中小银行上半年投资收益颇丰，更有银行投资收益同比翻倍增长。受访人士认为，这与中小银行上半年债券投资收益增加密不可分。基于市场行情变化、资产荒、投资受限等因素影响，一些中小银行债市操作风生水起。
- (3) **美国楼市领先指标 7 月跌至有记录以来的最低水平。**周四，全美房地产经纪人协会（NAR）的数据显示，美国 7 月成屋签约销售指数环比下跌 5.5%，跌至 70.2，为 2001 年有数据记录以来的最低水平，市场预期为上涨 0.2%，6 月前值为上涨 4.8%。7 月最终读数低于媒体对所有经济学家的调查估计。7 月成屋签约销售指数同比下跌 4.6%，预期为下跌 2%，前值为下跌 7.8%。

市场动态

- (1) 周四央行开展 1509 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3593 亿，全口径资金净回笼 2084 亿。今日逆回购到期 3793 亿元。周四资金面整体均衡偏松。
- (2) 周四国债期货主力合约全线收跌，现券收益率短端下行，长端上行。110 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.830，较上个交易日下跌 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.485，较上个交易日下跌 0.05%。剩余期限 9.68 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2500%/2.2480%，剩余期限 9.74 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1690%/2.1690%。
- (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 7.0980，较前一交易日夜盘收涨 310 个基点，成交量 486.04 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 湖南 31 等地方政府债共 20 只，计划发行规模 1062.32 亿；24 浦发银行 CD222 等同业存单共 35 只，计划发行规模 98.90 亿；24 国开 08(增 11)等金融债共 2 只，计划发行规模 113.00 亿；24 西港 MTN001 等中期票据共 7 只，计划发行规模 96.95 亿；24 津保投 SCP015 等短期融资券共 4 只，计划发行规模 36.00 亿。共计 68 只债券发行，计划发行规模 1407.17 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu