



【2024-10-15】

财经新闻

- (1) **年内新增专项债券发行规模已超全年限额九成。**据证券日报，2024 年我国安排新增专项债券 3.9 万亿元，是历年来规模最大的一年。数据显示，截至 10 月 14 日，各地发行新增专项债券规模达到 36160 亿元，约为全年限额（39000 亿元）92.7%，超过九成。
- (2) **新华社：财政增量政策即将到来，规模或在 2.2 万亿元之上。**新华社发文，回看往年数据，去年置换规模超 2.2 万亿元。这表明新措施规模一定會在 2.2 万亿元之上。值得注意的是，以前一直表态较为平稳的财政部此次强势“放话”，“近年来力度最大”“一次性较大规模”等表述也充满想象空间。可以期待，一个有力度的财政增量政策即将到来。
- (3) **美联储理事沃勒：美国经济或仍以高于预期速度运行，未来降息需更加谨慎。**美联储极具影响力的理事沃勒暗示，未来降息幅度将小于 9 月份的大幅降息。他表示，无论近期发生什么，他的基本观点仍然是，逐步降低政策利率。沃勒预计，受飓风和罢工影响，美国 10 月份可能损失 10 万个非农就业岗位。同日，2026 年票委卡什卡利表示，美联储进一步温和下调利率可能是合适的。

市场动态

- (1) 周一央行开展 195 亿 7 天期逆回购操作，无逆回购到期，资金净投放 195 亿。今日逆回购到期 417 亿。周一资金面整体均衡偏松。
- (2) 周一国债期货主力合约多数收跌，现券收益率全天窄幅震荡。10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.935，较上个交易日下跌 0.04%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.755，较上个交易日下跌 0.02%。剩余期限 9.56 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2225/2.2175%，剩余期限 9.61 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1325/2.1275%。
- (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 7.0900，较前一交易日夜盘收跌 231 个基点，成交量 361.35 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 四川债 61 等地方政府债共 8 只，计划发行规模 174.15 亿；24 交通银行 CD316 等同业存单共 141 只，计划发行规模 1221.50 亿；国开 15(增 19)等金融债共 9 只，计划发行规模 363.00 亿；24 中原发投小微债 01 企业债共 1 只，计划发行规模 2.60 亿；24 桂交投 MTN019B 等中期票据共 20 只，计划发行规模 173.49 亿；24 苏州高新 SCP051 等短期融资券共 27 只，计划发行规模 248.60 亿；24 洛阳城乡 PPN005 等定向工具共 4 只，计划发行规模 16.00 亿；24 汇聚融 4A1_bc 等资产支持证券共 14 只，计划发行规模 173.70 亿。共计 224 只债券发行，计划发行规模 2373.04 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu