

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-11-07】

财经新闻

- (1) **特别国债对国有大行的“注资”正在稳步推进。**据经济参考报了解，目前国有大型商业银行资本补充工作已经启动，财政部已会同有关金融管理部门成立了跨部门工作机制，多家大型银行已在研究论证核心一级资本补充的方案，正按照“统筹推进、分期分批、一行一策”的思路有序实施。
- (2) **海外机构调整对美联储利率路径的预测。**美银美林认为，如果特朗普上台并进行财政扩张，那么美联储可能会上调中性利率预期。摩根大通在特朗普赢得美国总统大选后调整了对美联储利率路径的预测，预计美联储从 3 月开始按季度降息。野村的经济学家现在预计美联储在 2025 年只会降息一次，并将终端利率预测上调 50 个基点，至 3.625%。
- (3) **欧元区 10 月综合、服务业 PMI 终值双双上修，均站上荣枯线。**欧元区 10 月综合 PMI 终值 50.0，较初值上修 0.3 个百分点，创两个月新高。服务业 PMI 终值为 51.6，较初值 51.2 上修 0.4 个百分点，为两个月高点。四大经济体中，法国与西班牙服务业 PMI 下降，且仅法国服务业 PMI 低于 50 荣枯线。

市场动态

- (1) 周三央行开展 173 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 4310 亿，资金净回笼 4137 亿。今日逆回购到期 3276 亿。周三资金面整体均衡。
- (2) 周三国债期货主力合约多数收跌，现券收益率午后震荡上行。10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 106.320，较上个交易日持平；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.895，较上个交易日下跌 0.02%。剩余期限 9.70 年的国开债活跃券 240215 收益率报 2.1850%/2.1830%，剩余期限 9.55 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1200%/2.1150%。
- (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 7.1796，较前一交易日夜盘收跌 736 个基点，成交量 638.53 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 黑龙江 39 等地方政府债共 2 只，计划发行规模 30.22 亿；24 华夏银行 CD338 等同业存单共 96 只，计划发行规模 551.20 亿；24 国开 16(增 4)等金融债共 8 只，计划发行规模 470.00 亿；24 徐工机械 GN001(科创票据)中期票据共 1 只，计划发行规模 5.00 亿；24 中海油国际 SCP001 等短期融资券共 7 只，计划发行规模 52.00 亿；24 新合盛 PPN002 等定向工具共 2 只，计划发行规模 6.50 亿。共计 116 只债券发行，计划发行规模 1114.92 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu