

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-07-12】

财经新闻

- (1) **2023 年增发国债项目全部开工。**截止到 6 月底，我国去年四季度推出的增发万亿元国债项目已全部开工建设。截至 6 月 30 日，增发国债 1.5 万个项目已全部开工，已完成总投资 4800 亿元。去年 11 月份以来，我国下达 1 万亿元增发国债资金，重点支持灾后恢复重建和提升防灾减灾能力、骨干防洪治理工程等 8 个领域项目建设。
- (2) **美国 6 月 CPI 环比四年来首次转负，核心同比增速创逾三年新低。**7 月 11 日周四，美国劳工部公布数据显示，美国 6 月 CPI 同比上涨 3%，略低于预期 3.1%，较前值 3.3%进一步下滑，环比下降 0.1%，预期 0.1%，前值为 0%，为 2020 年 5 月以来首次转负。
- (3) **报道称日本财务省出手干预，美国 CPI 数据公布后，日元飙升近 3%。**周四，美元兑日元汇率一度飙升至 157.40，最大升幅近 3%，创下自 2022 年末以来的最大单日涨幅。虽然日本财务省外汇事务主管神田真人当日早些时候回应称，他无法评论这一波动是否为干预所致，但随后有报道称，日本政府一名不具名的官员报道证实，日本当局就是在 7 月 11 日干预了汇市，以求提振日元。

市场动态

- (1) 周四央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，资金零投放零回笼。今日逆回购到期 20 亿。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涨，现券收益率整体小幅下行。10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 105.130，较上个交易日上涨 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.895，较上个交易日上涨 0.02%。剩余期限 9.49 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3420%/2.3410%，剩余期限 9.63 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.2650%/2.2640%。
- (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 7.2576，较前一交易日夜盘收涨 184 个基点，成交量 475.73 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 附息国债 14 等国债共 3 只，计划发行规模 1680.00 亿；24 湖南 23 等地方政府债共 2 只，计划发行规模 279.78 亿；24 交通银行 CD230 等同业存单共 180 只，计划发行规模 2435.20 亿；24 国开 03(增 22)等金融债共 6 只，计划发行规模 185.00 亿；24 国联 MTN007 等中期票据共 23 只，计划发行规模 277.96 亿；24 苏州资产 SCP004 等短期融资券共 18 只，计划发行规模 148.94 亿；24 邦鑫 ABN004 优先等资产支持证券共 2 只，计划发行规模 5.97 亿。共计 234 只债券发行，计划发行规模 5012.85 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu