

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-07-02】

财经新闻

- (1) **6月三大政策性银行净归还抵押补充贷款1274亿元。**央行数据显示，6月，国家开发银行、中国进出口银行、中国农业发展银行净归还抵押补充贷款1274亿元。期末抵押补充贷款余额为28245亿元。
- (2) **央企清理参股金融机构股权进程正进一步提速。**中国证券报数据显示，今年以来截至6月已有7笔此类股权被清理，包括中国船舶、鞍钢集团、大唐集团、华电集团等旗下子公司在产权交易平台均挂牌出售参股的金融机构股权，覆盖银行、保险、证券、信托等多类牌照。部分央企甚至集中清理金融机构股权，如中煤集团2024年1月挂牌出售持有的中煤财险、中诚信托股权，4月清仓出售山西山阴农商行股权。
- (3) **欧洲央行行长拉加德：欧洲央行需要时间权衡通胀不确定性。**当地时间7月1日周一，拉加德在葡萄牙出席欧洲央行年度央行论坛开幕式时表示，目前还没有足够的证据表明，欧元区已经渡过通胀的威胁。欧洲央行行长拉加德说，需要时间收集足够的数据，确定通胀高于目标的风险已经过去，也需要注意增长前景仍然不确定。媒体认为，拉加德的表态加剧了外界对欧央行本月将暂停降息的预期。
- (4) **美国ISM制造业PMI连续三个月萎缩。**7月1日周一，ISM公布的数据显示，美国6月ISM制造业指数48.5，不及预期的49.1，5月前值为48.7。美国6月ISM制造业PMI与5月读数相差不大。此前3月，美国ISM制造业指数意外大幅好于预期，突破50大关，达到50.3，结束了连续16个月的制造业收缩。不过从之后几个月的数据来看，美国制造业的复苏之路仍然颠簸，单月实现的扩张也仅昙花一现。

市场动态

- (1) 周一央行开展20亿7天期逆回购操作，逆回购到期500亿，资金净回笼480亿。今日逆回购到期3000亿。周一资金面整体均衡偏松。
- (2) 周一国债期货主力合约全线收跌，现券收益率大幅上行。10年期国债期货主力合约T2409收报104.975，较上个交易日下跌0.37%；5年期国债期货主力合约TF2409收报103.765，较上个交易日下跌0.24%。剩余期限9.52年的国开债活跃券240205收益率报2.3575%/2.3560%，剩余期限9.65年的国债活跃券240004收益率报2.2750%/2.2700%。
- (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7.2683，较前一交易日夜盘收跌11个基点，成交量192.02亿美元。

一级市场

今日银行间市场有24云南债09等地方政府债共2只，计划发行规模198.78亿；24建设银行CD224等同业存单共70只，计划发行规模274.40亿；24国开10(增17)等金融债共7只，计划发行规模558.00亿；24中车集MTN003等中期票据共16只，计划发行规模119.63亿；24苏州高新SCP033等短期融资券共12只，计划发行规模128.23亿。共计107只债券发行，计划发行规模1279.04亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu