

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-08-02】

财经新闻

- (1) **央行：7月三大政策性银行净归还抵押补充贷款 925 亿元。**7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 925 亿元。期末抵押补充贷款余额为 27320 亿元。
- (2) **英国央行四年来首次降息，将“谨慎”采取下一步行动。**周四，英国央行宣布将利率下调 25 基点至 5%，符合市场预期，这是 2020 年初以来英国央行首次降息。英国央行行长贝利在货币政策声明中表示，通胀压力已经得到缓解，我们今天可以下调利率。但我们需要确保通胀率保持在低位，并注意不要过快或过多地下调利率。
- (3) **美国 ISM 制造业 PMI 萎缩幅度创八个月最大。**8 月 1 日周四，ISM 公布的数据显示，美国 7 月 ISM 制造业 PMI 指数 46.8，预期 48.8，6 月前值为 48.5，萎缩幅度创八个月最大，新订单和产出下滑，造成就业人口创下四年来的最大降幅。

市场动态

- (1) 周四央行开展 103.7 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 2351 亿，资金净回笼 2247.3 亿。今日逆回购到期 3580.50 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，现券收益率震荡下行。10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 106.265，较上个交易日上涨 0.14%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 104.655，较上个交易日上涨 0.11%。剩余期限 9.76 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.1900%/2.1875%，剩余期限 9.81 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1120%/2.1110%。
- (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 7.2460，较前一交易日夜盘收跌 195 个基点，成交量 470.85 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 特别国债 04(续发)等国债共 2 只，计划发行规模 740.00 亿；24 浦发银行 CD213 等同业存单共 131 只，计划发行规模 1102.80 亿；24 国开 08(增 3)等金融债共 3 只，计划发行规模 135.00 亿；24 华发实业 MTN002A 等中期票据共 12 只，计划发行规模 127.60 亿；24 珠海港 SCP006 等短期融资券共 8 只，计划发行规模 51.60 亿。共计 156 只债券发行，计划发行规模 2157.00 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ellen Liu