

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-08-20】

财经新闻

- (1) **减配现金及银行存款，理财资金增配同业存单与公募基金。**据中证报统计，当前已有共 10 家理财公司发布了上半年理财业务报告。经梳理发现，与 2023 年末相比，尽管理财产品存续规模普遍增长，但理财机构对现金及银行存款的配置有所减少；同时，同业存单、公募基金则成为增配重点。业内人士认为，这主要是由于上半年协议存款收紧、手工补息被叫停，银行理财再难寻得高利率存款产品。为保证“达基率”，理财公司需要寻找其他收益率更高的低风险资产。
- (2) **8 月份新增专项债发行 89 只，发行规模为 2794.2 亿元。**据证券日报，Wind 数据显示，截至 8 月 19 日，8 月份以来各地已发行新增专项债 89 只，发行额合计为 2794.2 亿元，发行规模已接近 7 月份整月水平。
- (3) **新兴市场货币指数创纪录高位，投资者关注杰克逊霍尔全球央行年会。**项衡量发展中市场货币的指标周一升至创纪录水平，交易员准备在本周晚些时候杰克逊霍尔年会上寻找有关美国利率路径的线索。MSCI 新兴市场货币指数上涨 0.6%，泰铢和马来西亚林吉特兑美元领涨。

市场动态

- (1) 周一央行开展 521 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 745 亿，资金净回笼 224 亿。今日逆回购到期 3857 亿元。周一资金面整体均衡稍紧。
- (2) 周一国债期货主力合约全线收涨，现券收益率维持震荡。10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.800，较上个交易日上涨 0.14%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.395，较上个交易日上涨 0.07%。剩余期限 9.71 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2235%/2.2225%，剩余期限 9.76 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1750%/2.1600%。
- (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 7.1390，较前一交易日夜盘收涨 205 个基点，成交量 492.73 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 北京 51 等地方政府债共 13 只，计划发行规模 260.20 亿；24 中信银行 CD247 等同业存单共 138 只，计划发行规模 2644.70 亿；24 国开 15(增 9)等金融债共 7 只，计划发行规模 497.00 亿；24 中储发展 MTN001 等中期票据共 31 只，计划发行规模 180.60 亿；24 中铝资本 SCP004 等短期融资券共 26 只，计划发行规模 207.43 亿；24 狮桥租赁 PPN002 定向工具共 1 只，计划发行规模 4.50 亿。共计 216 只债券发行，计划发行规模 3794.43 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu

禁止处理涉密信息和内部敏感信息