

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-06-05】

财经新闻

- (1) **央行公布 2024 年度公开市场业务一级交易商名单。**近日，央行公布了 2024 年度公开市场业务一级交易商名单。对比 2023 年公开市场业务一级交易商名单，银行总数没有发生变化，仍维持在 51 家。值得注意的是，今年青岛农商银行成功跻身公开市场业务一级交易商行列，而青岛银行则被移出名单。
- (2) **年内规模增加超 1900 亿元，逾百只短债基金启动限购。**据证券日报，近期，已有多只短债基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务。截至 2024 年 6 月 4 日，短期纯债基金规模实现进一步增长，达 12013.62 亿元，年内基金规模增加超 1900 亿元。受访业内人士认为，基金暂停大额申购或暂停申购，主要出于对控制基金规模 and 风险、保护基金份额持有人的利益等方面的综合考虑。未来仍看好债券市场投资机会和短债基金的配置价值。
- (3) **日本央行据悉最早将在下周的会议上讨论削减债券购买规模。**据彭博，知情人士透露，日本央行最快可能在下周的政策会议上讨论减少购债规模的问题。日本央行官员可能会考虑是否有适当时机放慢当前每月约 6 万亿日元（合 384 亿美元）的购债步伐，以及是否需要提供更多有关未来前景的细节，以提高可预测性。该银行将于 6 月 14 日结束为期两天的政策会议。知情人士表示，鉴于央行无意让债市参与者感到意外，任何转变都只会是渐进的、分阶段进行的。

市场动态

- (1) 周二央行开展 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 2500 亿。周二资金面整体均衡偏松。
- (2) 周二国债期货主力合约涨跌互现，现券收益率窄幅震荡。10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.575，较上个交易日上涨 0.06%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.550，较上个交易日下跌 0.01%。剩余期限 9.60 年的国开债活跃券 240205 收益率报 2.3960%/2.3930%，剩余期限 9.73 年的国债活跃券 240004 收益率报 2.3090%/2.3075%。
- (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 7.2402，较前一交易日夜盘收涨 11 个基点，成交量 379.23 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 贴现国债 30 等国债共 3 只，计划发行规模 1760.00 亿；24 中信银行 CD179 等同业存单共 147 只，计划发行规模 2705.20 亿；24 农发 10(增 8)等金融债共 7 只，计划发行规模 347.00 亿；24 锡产业 MTN006 等中期票据共 28 只，计划发行规模 459.29 亿；24 一汽租赁 CP006 等短期融资券共 24 只，计划发行规模 222.50 亿。共计 209 只债券发行，计划发行规模 5493.99 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/ Ellen Liu