

市场概述 晨报

常规报告系列

 **NEX** 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-09-02】

 财经新闻

(1) **中国 8 月官方制造业 PMI 为 49.1，中小型企业生产经营压力有所加大。**8 月 31 日国家统计局发布数据显示，8 月份制造业采购经理指数为 49.1%，比上月下降 0.3 个百分点，制造业景气度小幅回落。非制造业商务活动指数为 50.3%，比上月上升 0.1 个百分点；综合 PMI 产出指数为 50.1%，比上月略降 0.1 个百分点。大型企业 PMI 为 50.4%，比上月略降 0.1 个百分点；中、小型企业 PMI 分别为 48.7%和 46.4%，比上月下降 0.7 和 0.3 个百分点，中小型企业生产经营压力有所加大。

(2) **提前还贷冲击仍在：上半年 19 家大中型银行中 14 家房贷余额减少。**据澎湃新闻，国有大行受提前还贷的冲击最为明显，六大行按揭贷款上半年合计减少超 3200 亿，10 家股份行的个人住房贷款余额降幅不大。此外，在披露了相关数据的 14 家大中型上市银行中，13 家个人住房贷款不良率出现上升。

(3) **美国 7 月核心 PCE 物价指数同比上涨 2.6%，环比上涨 0.2%，双双持平前值。**美国 7 月核心 PCE 物价指数（剔除波动较大的食品和能源价格）同比上涨 2.6%持平前值，略不及预期的 2.7%；环比上涨 0.2%，持平预期和前值。此外，核心 PCE 在三个月的年化增长率为 1.7%，为今年以来最低增速。

(4) **美国 CFTC：黄金看涨情绪创逾四年新高。**美国商品期货交易委员会（CFTC）数据显示，8 月 27 日当周，投机者所持 COMEX 黄金净多头头寸增加 69 手合约，至 236,818 手合约，创逾四年新高。所持 COMEX 白银净多头

头寸增至 35,282 手合约，创六周新高。所持 COMEX 铜净多头头寸增至 18,920 手合约，创五周新高。所持 NYMEX 铂金净多头头寸增至 3,067 手合约，创六周新高。所持 NYMEX 钯金净空头头寸降至 13,692 手合约，创六周新低，多头绝对值和空头绝对值均创六周新低。



市场动态

(1) 上周五央行开展 301 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3793 亿，资金净回笼 3492 亿。今日逆回购到期 4710 亿元。上周五资金面整体均衡偏松。

(2) 上周五国债期货主力合约涨跌互现，现券收益率维持震荡。10 年期国债期货主力合约 T2412 收报 105.755，较上个交易日下跌 0.01%；5 年期国债期货主力合约 TF2412 收报 104.475，较上个交易日上涨 0.02%。剩余期限 9.68 年的国开债活跃券 240210 收益率报 2.2325%/2.2315%，剩余期限 9.73 年的国债活跃券 240011 收益率报 2.1550%/2.1530%。

(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 7.0920，较前一交易日夜盘收涨 60 个基点。成交量 637.4 亿美元，较前一交易日增加 151.36 亿美元。



一级市场

今日银行间市场有 24 浦发银行 CD223 等同业存单共 40 只，计划发行规模 337.90 亿；24 农发 13(增 6)等金融债共 4 只，计划发行规模 133.50 亿；24 邮政 MTN009 等中期票据共 29 只，计划发行规模 276.47 亿；24 中航产融 SCP006 等短期融资券共 29 只，计划发行规模 271.70 亿。共计 102 只债券发行，计划发行规模 1019.57 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