

市场概述 晨报

常规报告系列



【2024-06-14】

财经新闻

- (1) **贵州、宁夏发布三季度地方政府债券发行计划。**贵州省发布三季度地方政府债券发行计划，三季度拟发行 454.5111 亿元地方政府债券，其中新增一般债券 41.7241 亿元，新增专项债券 145 亿元，再融资一般债券 232.9920 亿元，再融资专项债券 34.7950 亿元。宁夏回族自治区发布 2024 年第三季度地方政府债券发行计划表，三季度拟发行 138.29 亿元地方政府债券，其中新增一般债券 55 亿元，新增专项债券 33.5 亿元，再融资一般债券 24.1 亿元，再融资专项债券 25.69 亿元。
- (2) **美国 5 月 PPI 环比不增反降 0.2%，为七个月来最大降幅。**6 月 13 日，美国劳工统计局公布的数据显示，美国 5 月 PPI 环比-0.2%，这是自 2023 年 10 月以来的最大环比降幅，低于预估的 0.1%，更大幅低于 4 月的 0.5%。
- (3) **由于预期美联储不会急于放松货币政策，美国货币市场基金资产规模升至纪录水平。**美国投资公司协会（ICI）周报显示，6 月 12 日当周，美国货币市场基金资产规模达到 6.12 万亿美元，连续第八周上升、并突破 4 月份所创历史最高位，6 月 5 日当周为 6.09 万亿美元。

市场动态

- (1) 上一个交易日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金零投放零回笼。今日逆回购到期 20 亿。上一个交易日资金面整体均衡偏紧，尾盘改善。
- (2) 上一个交易日国债期货主力合约涨跌互现，现券收益率短端小幅上行，长端小幅下行，10 年期国债期货主力合约 T2409 收报 104.720，较上个交易日上涨 0.02%；5 年期国债期货主力合约 TF2409 收报 103.615，较上个交易日下跌 0.01%，剩余期限 9.57 年的国开债活跃券 240205 收益率收报 2.3825%/2.3820%，剩余期限 9.70 年的国债活跃券 240004 收益率收报 2.3000%/2.2995%。
- (3) 据中国外汇交易中心数据显示，上个交易日在岸人民币对美元夜盘收报 7.22523，较前一交易日夜盘收跌 143 个基点，成交量 284.34 亿美元。

一级市场

今日银行间市场有 24 特别国债 03 等国债 2 只，计划发行规模 1710 亿；24 江西 27 等地方政府债 2 只，计划发行规模 118.08 亿；24 建设银行 CD195 等同业存单共 167 只，计划发行规模 2353.80 亿；24 太保寿险永续债 01 等金融债共 4 只，计划发行规模 160.00 亿；24 首创集 MTN003A 等中期票据共 14 只，计划发行规模 124.80 亿；24 海淀国资 CP001 等短期融资券共 9 只，计划发行规模 96.54 亿；24 兴瑞 3C 等资产支持证券 8 只，计划发行规模 18.92 亿。共计 198 只债券发行，计划发行规模 4563.22 亿。

以上仅供参考，谢谢！

文/Ellen Liu