

中国工商银行金融市场部

人民币汇率市场上周概览1
 外币汇率市场上周概览3
 人民币利率市场上周概览4
 人民币信用债市场上周概览8
 外币利率市场上周概览14
 贵金属市场上周概览16
 原油市场上周概览17
 基本金属市场上周概览18
 农产品市场上周概览19
 天然气市场上周概览20

免责声明:

本资讯由中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)整理撰写,资讯所引用信息均来自公开资料,我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。资讯所载观点、结论及意见仅代表分析师在报告发布时的个人判断,不代表工商银行立场,亦不构成任何投资与交易决策依据。对于任何因使用或信赖本资讯而造成(或声称造成)的任何直接或间接损失,我们不承担任何责任。本资讯版权仅为工商银行所有,未经书面许可,任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。

摘要:

● 人民币汇率市场上周概览

- ✓ 人民币中间价上周五报7.1088,较9月30日贬值约0.13%;银行间外汇市场人民币对美元汇率较9月30日贬值约1.39%,上周收于7.1931;1年期限美元对人民币掉期点较9月30日下行545个点,上周收于-2140。
- ✓ 1年期境外美元对人民币无本金交割远期(NDF)较前周上行240个点,上周收于7.0590。

● 外币汇率市场上周概览

- ✓ 美元指数较前周上涨0.46%,上周收于113.311。
- ✓ 欧元兑美元较前周下跌0.23%,上周收于0.9719。
- ✓ 美元兑日元较前周上涨2.35%,上周收于148.74。
- ✓ 澳元兑美元较前周下跌2.70%,上周收于0.6196。

● 人民币利率市场上周概览

- ✓ 货币市场:隔夜上海银行间同业拆放利率(Shibor)和隔夜回购定盘利率分别收于1.13%和1.20%,7天上海银行间同业拆放利率(Shibor)和7天回购定盘利率均收于1.60%附近。
- ✓ 二级市场:10年期国债收益率较前周下行4BP,上周收于2.73%;5年期国债收益率较前周下行5BP,上周收于2.54%。
- ✓ 一级市场:财政部招标发行1、2、3和6个月期贴现国债、以及5年期附息国债;农发行招标发行6个月、以及1、2、3、5、7和10年期固息债,国开行招标发行1、3、5、7、10和20年期固息债,进出口行招标发行1、2、3、5、7和10年期固息债。

● 人民币信用债市场上周概览

- ✓ 一级市场:共发行超短期融资券98支,规模合计1134.17亿元;短期融资券6支,规模合计114.50亿元;中期票据43支,规模合计513.88亿元。
- ✓ 二级市场:短期融资券收益率区间震荡,中期票据和企业债收益率均小幅下行。

● 外币利率市场上周概览(10年期国债)

- ✓ 美国国债价格下跌,收益率较前周上行13.7BP,上周收于4.018%。
- ✓ 德国国债价格下跌,收益率较前周上行15.2BP,上周收于2.346%。

● 贵金属市场上周概览

- ✓ 黄金价格较前周下跌3.11%,上周收于1641.76美元/盎司。
- ✓ 白银价格较前周下跌9.21%,上周收于18.26美元/盎司。
- ✓ 铂金价格较前周下跌1.45%,上周收于898.73美元/盎司。
- ✓ 钯金价格较前周下跌8.80%,上周收于1989.00美元/盎司。

● 原油市场上周概览

- ✓ WTI原油期货主力合约价格较前周下跌8.01%,上周收于84.54美元/桶。
- ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周下跌7.10%,上周收于91.46美元/桶。

● 基本金属市场上周概览

- ✓ LME3月期铜价格较前周上涨0.93%,上周收于7531.50美元/吨。

● 农产品市场上周概览

- ✓ CBOT大豆期货主力合约价格较前周上涨1.14%,上周收于1392.75美分/蒲式耳。

● 天然气市场上周概览

- ✓ NYMEX天然气期货主力合约价格较前周下跌2.00%,上周收于6.476美元/百万英热单位。

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周五（10月14日）报7.1088，较9月30日贬值约0.13%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较9月30日贬值约1.39%，上周最高价7.2251、最低价7.1000，收于7.1931，波幅为1.74%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五16:30，1年期限美元对人民币掉期点较9月30日下行545个点，上周最高价-1668、最低价-2145，收于-2140，波幅为22.29%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行240个点，上周最高价7.0860、最低价6.9894，收于7.0590，波幅为1.37%。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较 9 月 30 日 (点)	较上月 末 (点)	较去年 末 (点)
即期汇率						
中间价	-	-	7.1088	90	90	7331
银行间市场汇价	7.2251	7.1000	7.1931	1000	1000	8201
掉期点						
1 个月期限	-15.20	-141.70	-138	-49	-49	-327
2 个月期限	-219	-299	-299	-107	-107	-595
3 个月期限	-154	-490	-472	-168	-168	-902
6 个月期限	-770	-1070	-1067	-357	-357	-1867
1 年期限	-1668	-2145	-2140	-545	-545	-3634

数据来源：路透

表 2：境外美元对人民币无本金交割远期 (NDF) 汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较去年末 (点)	与境内价 差 (点)
1 个月期限	7.1720	7.0614	7.1490	480	7731	-303
2 个月期限	7.1751	7.0603	7.1515	455	7601	-117
3 个月期限	7.1741	7.0598	7.1510	460	7466	50
6 个月期限	7.1470	7.0363	7.1220	400	6771	356
1 年期限	7.0860	6.9894	7.0590	240	5421	799

数据来源：路透

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周上涨 0.46%，上周最高 113.920、最低 112.147，收于 113.311。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.23%，上周最高 0.9808、最低 0.9631，收于 0.9719。
- 美元兑日元较前周上涨 2.35%，上周最高 148.86、最低 145.22，收于 148.74。
- 澳元兑美元较前周下跌 2.70%，上周最高 0.6380、最低 0.6169，收于 0.6196。

表 3：国际外汇市场主要货币汇率变动

主要货币汇率	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
美元指数	113.311	0.46%	1.06%
欧元/美元	0.9719	-0.23%	-0.82%
美元/日元	148.74	2.35%	2.76%
澳元/美元	0.6196	-2.70%	-3.22%

数据来源：路透

◆ 人民币利率市场上周概览——货币市场

- 上周隔夜上海银行间同业拆放利率（Shibor）和隔夜回购定盘利率分别收于 1.13% 和 1.20%，7 天上海银行间同业拆放利率（Shibor）和 7 天回购定盘利率均收于 1.60% 附近。央行公开市场方面，上周一（10 月 10 日）进行逆回购操作 20 亿元，逆回购到期 930 亿元；上周二（10 月 11 日）进行逆回购操作 20 亿元，逆回购到期 620 亿元；上周三（10 月 12 日）进行逆回购操作 20 亿元，逆回购到期 670 亿元；上周四（10 月 13 日）进行逆回购操作 20 亿元，逆回购到期 770 亿元；上周五（10 月 14 日）进行逆回购操作 20 亿元，逆回购到期 580 亿元。本周（10 月 17 日-10 月 21 日）将有逆回购到期 290 亿元，另有中期借贷便利（MLF）到期 5000 亿元，若央行不进行其他操作，本周公开市场将净回笼资金 5290 亿元。

表 4：人民币货币市场利率变动

	收盘利率(%)	较前周(BP)	较上月末(BP)
隔夜 Shibor (ON)	1.13	2	-95
7 天 Shibor (1W)	1.59	10	-46
3 月期 Shibor (3M)	1.68	0	1
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.20	4	-100
7 天回购定盘利率 (FR007)	1.60	6	-46

数据来源：银行间外汇交易中心

◆ 人民币利率市场上周概览——二级市场

- 国债方面，收益率小幅下行。1年期国债收益率较前周下行3BP，上周收于1.76%；5年期国债收益率较前周下行5BP，上周收于2.43%；10年期国债收益率较前周下行4BP，上周收于2.73%。
- 政策性金融债方面，收益率小幅震荡。1年期国开债收益率较前周上行3BP，上周收于1.89%；5年期国开债收益率较前周下行5BP，上周收于2.54%；10年期国开债收益率较前周下行6BP，上周收于2.92%。

表 5：银行间固定利率国债收益率变动

国债	收盘收益率(%)	较前周(BP)	较上月末(BP)
1年期	1.76	-3	-10
3年期	2.18	-3	-8
5年期	2.43	-5	-10
7年期	2.66	-3	-4
10年期	2.73	-4	-4

数据来源：工商银行

表 6：银行间固定利率政策性金融债收益率变动

政策性金融债（国开债）	收盘收益率(%)	较前周(BP)	较上月末(BP)
1年期	1.89	3	-0
3年期	2.26	-2	-6
5年期	2.54	-5	-9
7年期	2.80	-8	-12
10年期	2.92	-6	-9

数据来源：工商银行

◆ 人民币利率市场上周概览——一级市场

- 国债方面，上周三财政部发行 1 和 2 个月期贴现国债；上周五财政部发行 3 和 6 个月期贴现国债、以及 5 年期付息国债。
- 政策性金融债方面，上周一农发行招标发行 3 和 5 年期固息债。上周二农发行招标发行 2 和 7 年期固息债；国开行招标发行 1、3、5 和 7 年期固息债。上周三农发行招标发行 6 个月、以及 1 和 10 年期固息债。上周四国开行招标发行 3、10 和 20 年期固息债；进出口行招标发行 1、3、5 和 10 年期固息债。上周五进出口行招标发行 1、2 和 7 年期固息债。

◆ 人民币利率市场上周概览——利率互换市场

- 利率互换方面，截至上周五，以 7 天回购定盘利率（Repo）为浮动端基准的收益率曲线较前周下行 0 至 4BP；以 3 个月上海银行间同业拆放利率（Shibor）为浮动端基准的收益率曲线较前周下行 2 至 6BP；以 1 年期定存利率为浮动端基准的 2 年期利率互换（Depo 2y）收益率与前周持平，上周收于 1.63%；以 1 年期定存利率为浮动端基准的 3 年期利率互换（Depo 3y）收益率与前周持平，上周收于 1.63%。

表 7：人民币利率互换变动

	收盘利率 (%)	较前周 (BP)	较上月 (BP)
7 天 Repo (ACT/365)			
3 月期	1.77	0	-8
6 月期	1.84	-2	-8
9 月期	1.89	-3	-8
1 年期	1.95	-3	-8
3 年期	2.27	-3	-7
4 年期	2.39	-4	-8
5 年期	2.50	-4	-7
7 年期	2.64	-4	-8
10 年期	2.80	-4	-8
3 月 Shibor (ACT/360)			
6 月期	1.83	-2	-5
9 月期	1.94	-3	-7
1 年期	2.06	-4	-9
2 年期	2.32	-5	-11
3 年期	2.53	-6	-10
4 年期	2.73	-6	-9
5 年期	2.89	-4	-7
1 年 Depo (ACT/365)			
2 年期	1.63	0	0
3 年期	1.63	0	0
4 年期	1.59	0	0
5 年期	1.60	0	0

数据来源：工商银行

◆ 人民币信用债市场上周概览——一级市场

- 上周共发行超短期融资券 98 支，规模合计 1134.17 亿元；短期融资券 6 支，规模合计 114.50 亿元；中期票据 43 支，规模合计 513.88 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限波动-7 至 4BP。
- 经济方面，9 月 CPI 同比增长 2.8%，预期为 3%，前值为 2.5%；核心 CPI 同比增长 0.6%，前值为 0.8%；9 月 PPI 同比增长 0.9%，预期为 1.1%，前值为 2.3%。
- 政策方面，未来五年是全面建成社会主义现代化强国战略开局起步的关键时期，坚持以推动高质量发展为主题，把实施扩大内需战略同深化供给侧结构性改革有机结合起来，推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。

表 8：一级市场信用债发行情况

超短期融资券	发行利率 (%)	发行期限 (天)	发行规模 (亿元)	主体评 级	债项评 级
22 中建八局 SCP008	1.30	11D	30.00	AAA	-
22 华能水电 GN014	1.55	43D	14.00	AAA	-
22 东方电气 SCP005 (科创票据)	1.44	60D	20.00	AAA	-
22 上海大众 SCP003	1.85	60D	5.00	AAA	-
22 中色 SCP007	1.70	63D	7.00	AAA	-
22 广物控股 SCP007	1.78	70D	10.00	AAA	-
22 中材科技 SCP004 (科创票据)	1.49	74D	8.00	AAA	-
22 蓝星 SCP009	1.62	76D	5.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP043 (科创票据)	1.60	77D	10.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP041	1.60	77D	10.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP044 (乡村振兴)	1.60	77D	5.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP042 (科创票据)	1.60	77D	10.00	AAA	-
22 伊利实业 SCP030	1.50	77D	35.00	AAA	-
22 大众交通 SCP002	1.88	77D	12.00	AAA	-
22 伊利实业 SCP029	1.50	78D	45.00	AAA	-
22 伊利实业 SCP026	1.50	78D	50.00	AAA	-

22 伊利实业 SCP028	1.50	78D	30.00	AAA	-
22 伊利实业 SCP027	1.50	78D	70.00	AAA	-
22 伊利实业 SCP024	1.50	78D	30.00	AAA	-
22 伊利实业 SCP025	1.50	78D	20.00	AAA	-
22 伊利实业 SCP023	1.50	78D	70.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP037 (科创票据)	1.60	79D	5.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP040 (科创票据)	1.60	79D	10.00	AAA	-
22 中车 SCP010	1.50	79D	30.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP039 (科创票据)	1.60	79D	10.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP038 (科创票据)	1.60	79D	10.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP034 (科创票据)	1.60	79D	10.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP036 (科创票据)	1.60	79D	20.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP035	1.60	79D	10.00	AAA	-
22 国药控股 SCP006	1.55	79D	20.00	AAA	-
22 中车 SCP009	1.50	79D	30.00	AAA	-
22 中建二局 SCP004	1.58	80D	20.00	AAA	-
22 中能建 SCP002	1.50	80D	10.00	AAA	-
22 中兴通讯 SCP033	1.60	81D	5.00	AAA	-
22 悦达 SCP008	4.70	90D	5.00	AAA	-
22 苏交通 SCP023	1.51	90D	20.00	AAA	-
22 云投 SCP031	4.90	140D	6.00	AAA	-
22 苏国信 SCP017	1.71	168D	10.00	AAA	-
22 巨石 SCP005	1.83	177D	5.00	AAA	-
22 冀中能源 SCP004	4.48	180D	5.00	AAA	-
22 国能租赁 SCP005	1.87	180D	10.00	AAA	-
22 水发集团 SCP008	4.58	180D	15.00	AAA	-
22 福建港口 SCP003	1.70	180D	10.00	AAA	-
22 招商蛇口 SCP005	1.80	180D	10.00	AAA	-
22 招商蛇口 SCP006	1.80	180D	12.90	AAA	-
22 上海机场 SCP011	1.71	182D	10.00	AAA	-
22 上实 SCP004	1.70	184D	15.00	AAA	-
22 海尔金控 SCP006	2.22	199D	10.00	AAA	-
22 苏州高新 SCP029	1.89	254D	2.00	AAA	-
22 国新租赁 SCP002	1.85	258D	17.00	AAA	-
22 苏州交投 SCP002	1.82	260D	2.00	AAA	-
22 环球租赁 SCP012	2.08	266D	5.00	AAA	-
22 厦国贸控 SCP007	2.40	267D	10.00	AAA	-
22 融和融资 SCP006	1.93	268D	5.00	AAA	-
22 中航产融 SCP003	2.16	268D	10.00	AAA	-
22 深业 SCP006	1.88	269D	20.00	AAA	-
22 知识城 SCP012	1.95	270D	8.00	AAA	-
22 国新保理 SCP006	2.08	270D	10.00	AAA	-
22 青岛西海 SCP003	2.30	270D	3.40	AAA	-
22 日照港 SCP004	1.98	270D	9.00	AAA	-

22 鲁高速 SCP005	1.79	270D	20.00	AAA	-
22 海南农垦 SCP003	1.79	270D	2.50	AAA	-
22 张江高科 SCP002	1.78	270D	8.00	AAA	-
22 皖铁基金 SCP004	2.17	270D	5.00	AAA	-
22 济南高新 SCP007	2.27	270D	10.00	AAA	-
22 国丰集团 SCP002	1.80	270D	5.00	AAA	-
22 杭金投 SCP009	1.90	270D	9.00	AAA	-
22 盐城东方 SCP006	2.84	60D	4.00	AA+	-
22 金华城投 SCP007	1.80	80D	3.00	AA+	-
22 淮安国投 SCP005	1.87	90D	6.00	AA+	-
22 珠海交通 SCP005	1.88	147D	6.00	AA+	-
22 江宁国资 SCP003	2.10	160D	5.00	AA+	-
22 南京高科 SCP006	2.10	180D	3.00	AA+	-
22 如皋经贸 SCP003	2.40	180D	5.00	AA+	-
22 天津医药 SCP002	3.10	180D	5.00	AA+	-
22 海曙开发 SCP002	2.14	180D	3.50	AA+	-
22 中广核租 SCP004	1.99	268D	5.00	AA+	-
22 盐城高新 SCP001	3.36	268D	6.00	AA+	-
22 义乌商品 SCP005	2.43	268D	6.00	AA+	-
22 江阴公 SCP008	2.15	269D	5.00	AA+	-
22 连云城建 SCP004	2.37	270D	3.00	AA+	-
22 榆林城投 SCP002	2.29	270D	10.00	AA+	-
22 江宁国资 SCP004	2.26	270D	10.00	AA+	-
22 吴中国太 SCP006	2.24	270D	4.00	AA+	-
22 鑫城国资 SCP002	2.20	270D	5.00	AA+	-
22 现代投资 SCP001	1.85	270D	5.00	AA+	-
22 吴中经发 SCP009	2.08	270D	3.00	AA+	-
22 苏科技城 SCP001	2.30	39D	5.00	AA	-
22 昆山文商 SCP004	2.50	90D	3.00	AA	-
22 太仓水务 SCP005	2.30	120D	2.00	AA	-
22 南京软件 SCP002	2.40	180D	3.00	AA	-
22 张保实业 SCP002	2.45	268D	5.00	AA	-
22 兴化城投 SCP004	3.15	270D	4.00	AA	-
22 椒江社发 SCP003	2.30	270D	3.00	AA	-
22 浏阳现代 SCP002	3.07	270D	5.00	AA	-
22 高淳经开 SCP005	2.72	270D	5.00	AA	-
22 高淳文化 SCP001	3.30	270D	2.87	AA	-
22 潇湘源 SCP002	5.00	270D	3.00	AA	-
短期融资券	发行利率	发行期限	发行规模	主体评级	债项评级
	(%)	(天)	(亿元)		
22 中石油 CP003	1.79	365D	80.00	AAA	-
22 杭州水务 CP001	1.99	365D	7.00	AAA	-
22 青岛海控 CP002	2.42	365D	5.00	AAA	-
22 岳阳建投 CP001	2.39	365D	10.00	AA+	-

22 宁波经开 CP001	2.20	365D	5.00	AA+	-
22 秦皇城投 CP001	3.00	365D	7.50	AA	-
中期票据	发行利率	发行期限	发行规模	主体评	债项评
	(%)	(年)	(亿元)	级	级
22 核风电 GN003 (蓝债)	2.36	3.00	20.00	AAA	-
22 海淀国资 MTN001	3.40	3.00	30.00	AAA	-
22 招商公路 MTN003	2.85	3.00	15.50	AAA	AAA
22 华能 MTN009	2.78	3.00	20.00	AAA	AAA
22 卓越商业 MTN001	3.50	3.00	6.00	AAA	-
22 晋焦煤 MTN002	2.85	3.00	20.00	AAA	AAA
22 金融街投 MTN001	3.65	3.00	37.00	AAA	AAA
22 华润 MTN006	2.79	3.00	30.00	AAA	AAA
22 大兴发展 MTN001	2.75	3.00	14.30	AAA	AAA
22 宁沪高 MTN002	2.49	3.00	3.00	AAA	-
22 蜀道投资 MTN009	3.04	3.00	20.00	AAA	-
22 杭金投 MTN001	2.90	3.00	6.00	AAA	-
22 大唐发电 MTN009	2.79	3.00	20.00	AAA	AAA
22 中铁建 MTN001	2.79	3.00	30.00	AAA	AAA
22 铁建房产 MTN004	3.74	5.00	7.00	AAA	-
22 天津港 MTN001 (科创票据)	3.80	5.00	10.00	AAA	AAA
22 鲁能源 MTN005	3.39	5.00	20.00	AAA	-
22 南电 MTN003	2.95	5.00	25.00	AAA	-
22 首创城发 MTN003	4.30	5.00	12.00	AAA	AAA
22 紫金矿业 MTN003	3.20	7.00	15.00	AAA	-
22 津南城投 MTN001	7.50	2.00	8.25	AA+	-
22 泉州水务 MTN003	2.85	3.00	5.00	AA+	-
22 淮北建投 MTN005	3.90	3.00	5.00	AA+	-
22 肥西城乡 MTN001	2.85	3.00	7.63	AA+	-
22 北城建设 MTN001	2.94	3.00	5.00	AA+	-
22 乌经开 MTN003	3.20	3.00	5.00	AA+	-
22 黄石城发 MTN003	4.10	3.00	10.00	AA+	-
22 金阳投资 MTN001	4.15	3.00	10.00	AA+	-
22 义乌国资 MTN005	3.04	3.00	10.00	AA+	AA+
22 湖州城投 MTN005B (可持续挂 钩)	3.60	5.00	3.00	AA+	-
22 湖州城投 MTN005A (可持续挂 钩)	2.97	5.00	12.00	AA+	-
22 重庆物流 MTN002B	4.50	5.00	2.00	AA+	-
22 衡阳城投 MTN004	3.35	5.00	10.00	AA+	-
22 重庆物流 MTN002A	4.30	5.00	8.00	AA+	-
22 望城经开 MTN003	3.05	5.00	10.00	AA+	AA+
22 金阳新城 MTN003	3.79	5.00	7.00	AA+	-
22 海江投资 MTN002	3.45	5.00	5.00	AA+	-
22 即墨旅投 MTN001 (项目收益)	3.40	7.00	5.00	AA+	-

22 国兴投资 MTN001	3.30	7.00	6.10	AA+	-
22 徐州高新 MTN003	3.08	3.00	4.00	AA	-
22 宁波国贸 MTN001	2.90	3.00	5.00	AA	AAA
22 乳山国运 MTN001	6.50	3.00	4.00	AA	AA
22 铜陵建投 MTN001	3.55	5.00	6.10	AA	-

注：“—”代表截至发稿时相关信息尚未公告或不可得。

数据来源：万得

◆ 人民币信用债市场上周概览——二级市场

- 短期融资券方面，收益率区间震荡。AAA 级短期融资券中，1 个月品种收益率较前周下行 18BP，上周收于 1.82%；6 个月品种收益率较前周上行 1BP，上周收于 2.00%；1 年期品种收益率较前周上行 3BP，上周收于 2.10%。
- 中期票据方面，收益率小幅下行。AAA 级中期票据中，3 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.68%；5 年期品种收益率较前周下行 5BP，上周收于 3.15%。
- 企业债方面，收益率小幅下行。AAA 级企业债中，3 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.62%；5 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.94%；10 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 3.35%。

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格较前周下跌，10年期美国国债收益率较前周上行13.7BP，上周收于4.018%。
- 德国国债价格较前周下跌，10年期德国国债收益率较前周上行15.2BP，上周收于2.346%。

表 9：主要国家政府债券收益率变动

美国国债	收盘收益率 (%)	较前周 (BP)	较上月末 (BP)	较去年末 (BP)
2年	4.496	18.8	21.7	376.4
5年	4.268	12.5	17.8	300.5
10年	4.018	13.7	19.0	250.8
30年	3.992	15.0	21.6	208.8
德国国债				
2年	1.956	9.0	19.7	257.6
5年	2.114	7.6	15.1	256.7
10年	2.346	15.2	23.8	252.3
30年	2.399	26.2	30.7	220.2

数据来源：彭博

◆ 外币利率市场上周概览——利率掉期市场

- 美元利率掉期率整体上行，10年期美元利率掉期率较前周上行12.48BP，上周收于4.0214%。

表 10：美元利率掉期率变动

	收盘收益率(%)	较前周(BP)	较上月末(BP)	较去年末(BP)
2年	4.8727	23.02	32.67	393.14
10年	4.0214	12.48	14.44	244.04
30年	3.5198	11.87	16.58	178.87

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周下跌 3.11%，上周最高 1699.79 美元/盎司、最低 1639.39 美元/盎司，收于 1641.76 美元/盎司。
- 白银价格较前周下跌 9.21%，上周最高 20.16 美元/盎司、最低 18.06 美元/盎司，收于 18.26 美元/盎司。
- 铂金价格较前周下跌 1.45%，上周最高 912.95 美元/盎司、最低 858.00 美元/盎司，收于 898.73 美元/盎司。
- 钯金价格较前周下跌 8.80%，上周最高 2269.18 美元/盎司、最低 1978.50 美元/盎司，收于 1989.00 美元/盎司。

表 11：贵金属市场主要品种价格变动

品种	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
黄金	1641.76	-3.11%	-1.08%
白银	18.26	-9.21%	-3.91%
铂金	898.73	-1.45%	4.63%
钯金	1989.00	-8.80%	-7.83%

数据来源：路透

◆ 原油市场上周概览

- WTI 原油期货主力合约价格较前周下跌 8.01%，上周最高 92.34 美元/桶、最低 84.22 美元/桶，收于 84.54 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周下跌 7.10%，上周最高 98.75 美元/桶、最低 91.08 美元/桶，收于 91.46 美元/桶。

表 12：原油市场主要品种价格变动

能源	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
NYMEX WTI 主力合约	84.54	-8.01%	7.15%
ICE Brent 主力合约	91.46	-7.10%	6.88%

数据来源：路透

◆ 基本金属市场上周概览

- LME3 月期铜价格较前周上涨 0.93%，上周最高 7695.50 美元/吨、最低 7402.00 美元/吨，收于 7531.50 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周上涨 0.17%，上周最高 2400.00 美元/吨、最低 2191.00 美元/吨，收于 2290.50 美元/吨。

表 13：基本金属市场主要品种价格变动

	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
基本金属			
LME 3 月铜	7531.50	0.93%	0.55%
LME 3 月铝	2290.50	0.17%	6.93%

数据来源：彭博

◆ 农产品市场上周概览

- CBOT 大豆期货主力合约价格较前周上涨 1.14%，上周最高 1423.25 美分/蒲式耳、最低 1377.00 美分/蒲式耳，收于 1392.75 美分/蒲式耳。
- 其他主要农产品价格详见下表。

表 14：农产品市场主要品种价格变动

	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
农产品与软商品			
CBOT 小麦(美分/蒲式耳)	861.25	-2.49%	-6.72%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1392.75	1.14%	1.29%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	690.75	1.13%	1.88%
ICE 棉花(美分/磅)	83.07	-1.18%	-1.73%
ICE 白糖(美分/磅)	18.82	0.70%	7.18%

数据来源：路透

◆ 天然气市场上周概览

- NYMEX 天然气期货主力合约价格较前周下跌 2.00%，上周最高 6.901 美元/百万英热单位、最低 6.337 美元/百万英热单位，收于 6.476 美元/百万英热单位。

表 15：天然气市场主要品种价格变动

	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
能源			
NYMEX 天然气	6.476	-2.00%	-5.13%

数据来源：路透