

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15
 贵金属市场上周概览17
 原油市场上周概览18
 基本金属市场上周概览19
 农产品市场上周概览20
 天然气市场上周概览21

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7.1186,较前周贬值约0.14%;银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.78%,上周收于7.2494;1年期限美元对人民币掉期点较前周下行320个点,上周收于-2460。
 - ✓ 1年期境外美元对人民币无本金交割远期(NDF)较前周上行102个点,上周收于7.0692。
- **外币汇率市场上周概览**
 - ✓ 美元指数较前周下跌1.15%,上周收于112.012。
 - ✓ 欧元兑美元较前周上涨1.45%,上周收于0.9860。
 - ✓ 美元兑日元较前周下跌0.74%,上周收于147.64。
 - ✓ 澳元兑美元较前周上涨2.92%,上周收于0.6377。
- **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均收于1.28%附近,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1.68%附近。
 - ✓ 二级市场:10年期国债收益率较前周上行3BP,上周收于2.76%;5年期国开债收益率与前周持平,上周收于2.54%。
 - ✓ 一级市场:财政部招标发行91和182天期贴现国债,2和10年期附息国债;农发行招标发行182天、1、3、5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116支,规模合计914.90亿元;短期融资券17支,规模合计165.30亿元;中期票据70支,规模合计876.30亿元。
 - ✓ 二级市场:短期融资券收益率区间震荡,中期票据、企业债收益率均有所下行。
- **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19.8BP,上周收于4.217%。
 - ✓ 德国国债价格下跌,收益率较前周上行7.1BP,上周收于2.417%。
- **贵金属市场上周概览**
 - ✓ 黄金价格较前周上涨0.91%,上周收于1656.66美元/盎司。
 - ✓ 白银价格较前周上涨6.24%,上周收于19.40美元/盎司。
 - ✓ 铂金价格较前周上涨3.71%,上周收于932.06美元/盎司。
 - ✓ 钯金价格较前周上涨1.48%,上周收于2018.50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上涨0.71%,上周收于85.14美元/桶。
 - ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周上涨2.34%,上周收于93.60美元/桶。
- **基本金属市场上周概览**
 - ✓ LME3月期铜价格较前周上涨1.58%,上周收于7650.50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0.65%,上周收于1401.75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19.52%,上周收于5.516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21日）报7.1186，较前周贬值约0.14%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.78%，上周最高7.1090、最低7.2528，收于7.2494，波幅为1.98%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周下行320个点，上周最高-2158、最低-2513，收于-2460，波幅为14.43%。
- 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102个点，上周最高7.1107、最低7.0092，收于7.0692，波幅为1.44%。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较上月 末(点)	较去年 末(点)
即期汇率						
中间价	-	-	7.1186	98	188	7429
银行间市场汇价	7.2528	7.1090	7.2494	563	1563	8764
掉期点						
1个月期限	-107	-151	-130	8	-40	-319
2个月期限	-270	-320	-304	-5	-111	-600
3个月期限	-485	-572	-530	-58	-226	-960
6个月期限	-1070	-1210	-1141	-74	-430	-1941
1年期限	-2158	-2513	-2460	-320	-865	-3954

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	7.2095	7.1184	7.1697	207	7938	-667
2个月期限	7.2135	7.1204	7.1735	220	7821	-455
3个月期限	7.2145	7.1189	7.1745	235	7701	-219
6个月期限	7.1841	6.8940	7.1397	177	6948	44
1年期限	7.1107	7.0092	7.0692	102	5523	658

数据来源：路透

◆ 外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周下跌 1.15%，上周最高 113.942、最低 111.703，收于 112.012。
- 欧元兑美元较前周上涨 1.45%，上周最高 0.9875、最低 0.9703，收于 0.9860。
- 美元兑日元较前周下跌 0.74%，上周最高 151.94、最低 146.19，收于 147.64。
- 澳元兑美元较前周上涨 2.92%，上周最高 0.6393、最低 0.6186，收于 0.6377。

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	112.012	-1.15%	-0.09%
欧元/美元	0.9860	1.45%	0.62%
美元/日元	147.64	-0.74%	2.00%
澳元/美元	0.6377	2.92%	-0.39%

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均收于 1.28% 附近，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 1.68% 附近。央行公开市场方面，上周一（10 月 17 日）进行逆回购操作 20 亿元和 MLF 操作 5000 亿元，逆回购到期 210 亿元和 MLF 到期 5000 亿元；上周二至上周五（10 月 18 日-10 月 21 日）每日均进行逆回购操作 20 亿元，逆回购到期 20 亿元。本周（10 月 24 日-10 月 28 日）有 100 亿元逆回购到期，若央行不进行其他操作，本周公开市场将回笼资金 100 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)	1.23	10	-85
7 天 Shibor (1W)	1.68	9	-37
3 月期 Shibor (3M)	1.70	2	3
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.32	12	-88
7 天回购定盘利率 (FR007)	1.67	7	-39

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，收益率区间震荡。1年期国债收益率较前周下行1BP，上周收于1.77%；5年期国债收益率较前周上行1BP，上周收于2.45%；10年期国债收益率较前周上行3BP，上周收于2.76%。
- 政策性金融债方面，收益率震荡上行。1年期国开债收益率与前周持平，上周收于1.89%；5年期国开债收益率与前周持平，上周收于2.54%；10年期国开债收益率较前周上行2BP，上周收于2.93%。

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	1.77	1	-8
3年期	2.17	-1	-9
5年期	2.45	1	-9
7年期	2.66	0	-4
10年期	2.76	3	-1

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	0	0
3年期	2.26	0	-6
5年期	2.54	0	-9
7年期	2.81	1	-11
10年期	2.93	2	-8

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（10月19日）财政部招标发行91天期贴现国债，2和10年期付息国债；上周五财政部招标发行182天期贴现国债。
- 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；上周二国开行招标发行1、5和7年期固息债；农发行招标发行2和7年期固息债。上周三农发行招标发行182天、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，收益率震荡上行。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上行 2BP 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上行 1BP 至 3BP；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	1.81	4	-4
6 月期	1.88	4	-4
9 月期	1.93	4	-4
1 年期	1.98	3	-4
3 年期	2.29	2	-4
4 年期	2.43	3	-5
5 年期	2.53	3	-4
7 年期	2.67	4	-4
10 年期	2.83	4	-4
3 月 Shibor (ACT/360)			
6 月期	1.86	2	-2
9 月期	1.97	3	-4
1 年期	2.08	2	-7
2 年期	2.34	2	-10
3 年期	2.55	2	-9
4 年期	2.74	2	-7
5 年期	2.91	1	-6
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 116 支，规模合计 914.90 亿元；短期融资券 17 支，规模合计 165.30 亿元；中期票据 70 支，规模合计 876.30 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限波动-2BP 至 6BP。
- 上周四（10 月 20 日），中国共产党第二十次全国代表大会新闻中心举行集体采访。中央金融系统代表团新闻发言人、中国人民银行副行长潘功胜在回答记者提问时表示，过去 10 年我国金融事业取得重大成就，金融支持实体经济质效大幅度提升，防范化解金融风险取得重要成果，金融业的改革开放持续深化，我国金融业的国际竞争力和影响力大幅提升。后续，金融系统将深入贯彻落实二十大报告精神，坚持党中央对金融工作的集中统一领导，坚持金融服务实体经济的宗旨，坚持统筹发展和安全、牢牢守住不发生系统性金融风险的底线，坚持深化金融改革开放，以高质量党建推动金融事业的高质量发展。实施好稳健的货币政策，强化跨周期和逆周期调节，为促进经济增长、扩大就业、稳定物价、维护国际收支平衡营造良好的货币金融环境。

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 华能集 SCP020	1.48	30D	20.00	AAA	-
22 华能 SCP011	1.48	32D	30.00	AAA	-
22 中建八局 SCP009	1.55	38D	30.00	AAA	-
22 雅砻江 SCP003	1.32	42D	10.00	AAA	-
22 江北新区 SCP002	1.70	50D	6.50	AAA	-

22 吉林电力 SCP001	1.75	50D	2.00	AAA	-
22 锡产业 SCP022	1.60	58D	3.00	AAA	-
22 沪电力 SCP009	1.41	58D	25.00	AAA	-
22 首旅 SCP015	1.63	60D	7.00	AAA	-
22 沪风电 SCP002	1.51	60D	20.00	AAA	-
22 首旅 SCP014	1.63	60D	7.00	AAA	-
22 东莞水务 SCP001	1.60	60D	5.00	AAA	-
22 中建六局 SCP006(科创票据)	1.65	65D	7.00	AAA	-
22 三一 SCP014(科创票据)	1.58	65D	10.00	AAA	-
22 中建五局 SCP002	1.55	68D	15.00	AAA	-
22 中建五局 SCP003	1.55	68D	15.00	AAA	-
22 三一重工 SCP011(科创票据)	1.57	70D	10.00	AAA	-
22 中交二公 SCP005	1.54	70D	8.00	AAA	-
22 南通沿海 SCP008	1.90	80D	8.00	AAA	-
22 融和融资 SCP007(绿色)	1.69	84D	5.00	AAA	-
22 龙源电力 SCP019	1.52	90D	20.00	AAA	-
22 华电江苏 SCP026	1.56	90D	6.00	AAA	-
22 华电江苏 SCP025	1.52	90D	6.00	AAA	-
22 徐工集团 SCP018	1.69	91D	4.00	AAA	-
22 徐工集团 SCP017	1.69	91D	4.00	AAA	-
22 徐工集团 SCP019	1.69	91D	3.00	AAA	-
22 国网租赁 SCP017	1.72	93D	10.00	AAA	-
22 中化工 SCP011	1.66	121D	20.00	AAA	-
22 陕西建工 SCP011	3.27	122D	8.00	AAA	-
22 鲁西化工 SCP004	1.78	123D	8.00	AAA	-
22 华能水电 SCP010	1.65	128D	20.00	AAA	-
22 云投 SCP032	4.80	140D	9.00	AAA	-
22 云建投 SCP024	5.80	150D	10.00	AAA	-
22 冀建投 SCP003	1.78	150D	5.00	AAA	-
22 天成租赁 SCP010	1.78	177D	10.00	AAA	-
22 中原资产 SCP003	3.25	180D	8.00	AAA	-
22 京建工 SCP004	1.78	180D	12.00	AAA	-
22 津保投 SCP015	4.98	180D	5.00	AAA	-
22 京国资 SCP004	1.71	180D	15.00	AAA	-
22 无锡城建 SCP003	1.85	180D	8.00	AAA	-
22 无锡城建 SCP004	1.85	180D	7.00	AAA	-
22 武金控 SCP005	2.33	180D	10.00	AAA	-
22 鲁高速股 SCP008	1.73	180D	10.00	AAA	-
22 文广集团 SCP002	1.69	180D	5.00	AAA	-
22 苏州高新 SCP030	1.89	254D	4.00	AAA	-
22 临港控股 SCP007	1.85	261D	10.00	AAA	-
22 厦门市政 SCP003	1.78	267D	4.00	AAA	-

22 锡产业 SCP020	1.90	268D	4.00	AAA	-
22 锡产业 SCP021	1.90	268D	3.00	AAA	-
22 皖能源 SCP006	1.79	268D	5.00	AAA	-
22 扬城建 SCP004	1.96	270D	1.00	AAA	-
22 申能集 SCP002	1.74	270D	20.00	AAA	-
22 紫金矿业 SCP005	1.84	270D	5.00	AAA	-
22 京国资 SCP003	1.74	270D	15.00	AAA	-
22 首旅酒店 SCP003	1.95	270D	4.00	AAA	-
22 广州地铁 SCP007	1.74	270D	20.00	AAA	-
22 陕西金控 SCP002	2.10	270D	4.00	AAA	-
22 闽电子 SCP006	4.29	270D	5.00	AAA	-
22 常城建 SCP008	1.90	270D	5.00	AAA	-
22 华电煤业 SCP002	2.18	270D	7.00	AAA	-
22 贵州交通 SCP003	2.55	270D	8.40	AAA	-
22 南电 SCP013	1.75	270D	50.00	AAA	-
22 津保投 SCP014	6.00	270D	8.00	AAA	-
22 青岛国信 SCP005	1.98	270D	10.00	AAA	-
22 锡产业 SCP019	1.90	270D	4.00	AAA	-
22 粤交投 SCP004	1.77	270D	8.00	AAA	-
22 华发集团 SCP009	2.35	270D	10.00	AAA	-
22 广东农垦 SCP002	1.82	270D	10.00	AAA	-
22 杭金投 SCP010	1.80	270D	7.00	AAA	-
22 桂铁投 SCP006	2.34	270D	5.00	AAA	-
22 西安高新 SCP005	2.60	270D	3.00	AAA	-
22 珠海港股 SCP007	1.83	23D	4.00	AA+	-
22 金华轨交 SCP003	1.70	35D	5.95	AA+	-
22 盐城东方 SCP007	2.75	60D	3.00	AA+	-
22 珠海交通 SCP006	1.72	83D	3.00	AA+	-
22 瀚蓝 SCP007	1.64	87D	5.60	AA+	-
22 常交通 SCP005	1.70	90D	5.00	AA+	-
22 新华报业 SCP007	1.75	121D	5.00	AA+	-
22 华银电力 SCP002	2.10	180D	5.00	AA+	-
22 海正药业 SCP003(科创票据)	2.80	180D	3.00	AA+	-
22 武进经发 SCP008	2.05	180D	5.00	AA+	-
22 海宁皮革 SCP003	1.90	180D	3.00	AA+	-
22 北方企业 SCP003	2.13	180D	5.00	AA+	-
22 成都益民 SCP001	2.10	180D	5.00	AA+	-
22 宜兴城投 SCP002	2.05	180D	1.80	AA+	-
22 麓山投资 SCP001	1.80	180D	6.00	AA+	-
22 鲁商 SCP013	5.80	180D	5.00	AA+	-
22 亨通 SCP005(科创票据)	5.49	180D	3.00	AA+	-
22 武进经发 SCP009	2.08	210D	5.00	AA+	-

22 青岛城阳 SCP002	2.60	266D	4.00	AA+	-
22 盐城高新 SCP002	3.32	268D	4.00	AA+	-
22 嘉公路 SCP003	1.90	269D	5.00	AA+	-
22 中飞租赁 SCP001(转型)	3.56	270D	10.00	AA+	-
22 湘建工 SCP001(科创票据)	2.18	270D	10.00	AA+	-
22 昆交产 SCP002	6.90	270D	15.00	AA+	-
22 伊犁财通 SCP004	2.39	270D	5.00	AA+	-
22 吴中经发 SCP010	2.15	270D	2.00	AA+	-
22 华电云南 SCP003	2.30	270D	3.00	AA+	-
22 镇江交通 SCP004	2.50	270D	4.50	AA+	-
22 株洲高科 SCP003	3.90	270D	5.00	AA+	-
22 鼓风机 SCP003	2.08	270D	6.00	AA+	-
22 吴中国太 SCP007	2.19	270D	1.90	AA+	-
22 常德城投 SCP003	2.27	270D	10.00	AA+	-
22 连云港 SCP008	3.00	270D	5.00	AA+	-
22 唐山金融 SCP001	5.50	270D	2.00	AA+	-
22 青岛海创 SCP002	2.97	270D	8.00	AA+	-
22 创元投资 SCP004	2.21	270D	4.00	AA+	-
22 海沧投资 SCP006	2.15	270D	3.00	AA+	-
22 苏科技城 SCP002	2.40	88D	3.00	AA	-
22 龙岩投资 SCP004	2.50	180D	3.00	AA	-
22 青岛水务 SCP004	2.00	180D	4.00	AA	-
22 浦口交通 SCP001	2.48	270D	1.50	AA	-
22 濮阳投资 SCP001	3.96	270D	0.75	AA	-
22 西安浐灞 SCP001	6.38	270D	5.00	AA	-
22 巴中国资 SCP002	5.00	270D	3.00	AA	-
22 蚌埠投资 SCP005	3.50	270D	3.00	AA	-

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 滨建投 CP003	5.50	270D	5.00	AAA	-
22 蓝星 CP003	1.98	365D	10.00	AAA	-
22 苏沙钢 CP003	2.43	365D	15.00	AAA	-
22 津城建 CP028	4.49	365D	10.00	AAA	-
22 云能投 CP007	3.85	365D	10.00	AAA	-
22 桂投资 CP001	2.70	365D	15.00	AAA	-
22 海淀国资 CP002	2.43	365D	30.00	AAA	-
22 楚天智能 CP002	2.00	90D	5.00	AA+	-
22 淮安交通 CP002	2.20	180D	7.30	AA+	-
22 滁州城投 CP001	2.28	365D	10.00	AA+	-
22 三门峡 CP003	2.60	365D	8.00	AA+	-
22 景德城投 CP001	3.89	365D	5.00	AA	A-1
22 磁湖高新 CP004	4.50	365D	5.00	AA	-

22 金坛国发 CP002	2.67	365D	5.00	AA	-
22 高淳国资 CP003	2.39	365D	5.00	AA	-
22 渭南城投 CP001	3.90	365D	10.00	AA	A-1
22 陕西水务 CP002	2.79	365D	10.00	AA	-

中期票据	发行利率 (%)	发行期限 (年)	发行规模 (亿元)	主体评级	债项评级
22 河钢股 MTN002	3.90	2.00	20.00	AAA	AAA
22 开滦 MTN003	5.18	2.00	5.00	AAA	-
22 云能投 MTN007	4.99	2.00	10.00	AAA	-
22 蜀道投资 MTN010(乡村振兴)	2.99	3.00	20.00	AAA	-
22 甬开投 MTN002	2.94	3.00	10.00	AAA	-
22 首农食品 MTN001	2.93	3.00	20.00	AAA	AAA
22 光明 MTN003	2.47	3.00	20.00	AAA	-
22 山西建投 MTN008	5.15	3.00	5.00	AAA	-
22 通商租赁 MTN002	2.69	3.00	10.00	AAA	-
22 宁舟港 MTN001	2.61	3.00	8.00	AAA	-
22 华润 MTN007	2.73	3.00	30.00	AAA	AAA
22 陕投集团 MTN005	3.37	3.00	15.00	AAA	AAA
22 华能集 MTN004(能源保供特别债)	2.73	3.00	20.00	AAA	AAA
22 云南机场 MTN001(可持续挂钩)	3.40	3.00	5.00	AAA	AAA
22 兴城投资 MTN004A	3.00	3.00	5.00	AAA	AAA
22 城投水务 MTN001	2.66	3.00	5.00	AAA	AAA
22 山东港口 MTN002	2.78	3.00	10.00	AAA	AAA
22 华侨城 MTN006	3.42	3.00	15.00	AAA	AAA
22 鲁高速 MTN006	2.97	3.00	30.00	AAA	AAA
22 格力 MTN003	3.05	3.00	10.00	AAA	-
22 贵州高速 MTN002	3.38	3.00	10.00	AAA	-
22 中国信科 MTN001(科创票据)	2.64	3.00	10.00	AAA	AAA
22 国盛 MTN004	2.80	5.00	20.00	AAA	-
22 大唐集 MTN008(能源保供特别债)	3.05	5.00	20.00	AAA	-
22 中燃投资 MTN001	3.00	5.00	10.00	AAA	-
22 川高速 MTN003	3.10	5.00	10.00	AAA	AAA
22 桂交投 MTN005	2.95	5.00	15.00	AAA	-
22 中化股 MTN009	3.05	5.00	20.00	AAA	-
22 兴城投资 MTN004B	3.58	5.00	5.00	AAA	AAA
22 紫金矿业 MTN004	2.79	5.00	15.00	AAA	-
22 科学城 MTN002	2.70	5.00	14.00	AAA	-
22 国新控股 MTN004(能源保供特别债)	2.85	5.00	200.00	AAA	AAA
22 沪国际集 MTN001	2.82	5.00	20.00	AAA	-
22 国盛 MTN003	2.86	5.00	24.00	AAA	-
22 浙能源 MTN003	2.93	5.00	10.00	AAA	-
22 鲁能源 MTN006	3.39	5.00	20.00	AAA	-

22 恒逸 MTN002	7.00	2.00	6.00	AA+	AA+
22 天辰工程 MTN001 (科创票据)	2.70	2.00	7.00	AA+	AA+
22 嘉定新城 MTN001	2.78	3.00	5.00	AA+	AA+
22 武进经发 MTN005	2.99	3.00	7.00	AA+	-
22 盐城交通 MTN003	2.98	3.00	5.00	AA+	-
22 汾湖投资 MTN003	3.00	3.00	2.00	AA+	-
22 水电八局 MTN003	3.56	3.00	2.20	AA+	AA+
22 国发 MTN001	3.10	3.00	5.00	AA+	AA+
22 静安置业 MTN001	2.79	3.00	8.50	AA+	-
22 泰兴城投 MTN002	3.53	3.00	6.00	AA+	-
22 嘉秀发展 MTN002	2.90	3.00	5.00	AA+	-
22 晋路桥 MTN001 (科创票据)	3.50	3.00	5.00	AA+	-
22 长沙水业 MTN002	2.84	5.00	3.50	AA+	-
22 漳州交通 MTN002	3.45	5.00	7.00	AA+	-
22 西安投资 MTN001	3.98	5.00	5.00	AA+	-
22 广东港航 MTN001	3.29	5.00	5.00	AA+	-
22 中核二四 MTN001	3.12	5.00	5.00	AA+	-
22 镇江城建 MTN003	3.90	5.00	5.00	AA+	-
22 江津华信 MTN002	3.30	5.00	3.40	AA+	-
22 武汉生态 MTN003	3.45	5.00	5.00	AA+	-
22 路桥公投 MTN001	2.98	5.00	4.00	AA+	-
22 高速路桥 MTN001	3.05	5.00	5.00	AA+	-
22 海城建设 MTN001	3.35	5.00	6.00	AA+	-
22 海宁城投 MTN004	2.85	5.00	5.00	AA+	-
22 宁经开 MTN002	3.49	5.00	10.00	AA+	AA+
22 吉林金控 MTN001	6.50	3.00	5.00	AA	-
22 伊宁国资 MTN001	6.76	3.00	4.00	AA	AA
22 徐工租赁 MTN002	3.17	3.00	6.00	AA	-
22 淮安经开 MTN002	4.40	3.00	5.00	AA	-
22 九龙园 MTN003	5.20	3.00	2.20	AA	-
22 叠石桥 MTN001	3.13	3.00	5.00	AA	-
22 太仓港 MTN004	3.13	3.00	2.00	AA	AA+
22 烟台财金 MTN001 (科创票据)	3.28	5.00	6.00	AA	-
22 金禹水利 MTN002	4.48	5.00	12.50	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：WIND 资讯

◆ 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 4BP，上周收于 1.78%；6 个月品种收益率较前周上行 1BP，上周收于 2.01%；1 年期品种收益率与前周持平，上周收于 2.1%。
- 中期票据方面，收益率震荡下行。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 2.64%；5 年期品种收益率较前周下行 7BP，上周收于 3.08%。
- 企业债方面，收益率震荡下行。AAA 级企业债中，3 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.58%；5 年期品种收益率较前周下行 5BP，上周收于 2.90%；10 年期品种收益率较前周下行 2BP，上周收于 3.33%。

◆ 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19.8BP，上周收于4.217%。
- 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7.1BP，上周收于2.417%。

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	4.472	-2.4	19.4	374.0
5年	4.341	7.3	25.1	307.8
10年	4.217	19.8	38.8	270.7
30年	4.334	34.2	55.8	243.0
德国国债				
2年	2.041	8.5	28.2	266.1
5年	2.212	9.8	24.9	266.5
10年	2.417	7.1	30.9	259.4
30年	2.442	4.3	35.0	224.5

数据来源：彭博

◆ 外币利率市场上周概览——利率掉期市场

- 美元利率掉期率区间震荡，10年期美元利率掉期率较前周上行 20.90BP，上周收于 4.2304%。

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	4.8668	-0.59	32.08	392.55
10 年	4.2304	20.90	35.34	264.94
30 年	3.8656	34.58	51.16	213.45

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周上涨 0.91%，上周最高 1668.19 美元/盎司、最低 1617.00 美元/盎司，收于 1656.66 美元/盎司。
- 白银价格较前周上涨 6.24%，上周最高 19.40 美元/盎司、最低 18.19 美元/盎司，收于 19.40 美元/盎司。
- 铂金价格较前周上涨 3.71%，上周最高 934.74 美元/盎司、最低 875.37 美元/盎司，收于 932.06 美元/盎司。
- 钯金价格较前周上涨 1.48%，上周最高 2092.72 美元/盎司、最低 1950.00 美元/盎司，收于 2018.50 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	1656.66	0.91%	-0.18%
白银	19.40	6.24%	2.11%
铂金	932.06	3.71%	8.51%
钯金	2018.50	1.48%	-6.46%

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上涨 0.71%，上周最高 87.14 美元/桶、最低 81.30 美元/桶，收于 85.14 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 2.34%，上周最高 94.77 美元/桶、最低 88.77 美元/桶，收于 93.60 美元/桶。

表 12：原油市场主要品种价格变动

	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
能源			
NYMEX WTI 主力合约	85.14	0.71%	7.91%
ICE Brent 主力合约	93.60	2.34%	9.38%

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 1.58%，上周最高 7650.50 美元/吨、最低 7365.00 美元/吨，收于 7650.50 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周下跌 3.14%，上周最高 2244.00 美元/吨、最低 2180.00 美元/吨，收于 2218.50 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	7650.50	1.58%	2.14%
LME 3 月铝	2218.50	-3.14%	3.57%

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 0.65%，上周最高 1407.25 美分/蒲式耳、最低 1366.75 美分/蒲式耳，收于 1401.75 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)	848.00	-1.54%	-8.15%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1401.75	0.65%	1.95%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	683.50	-1.05%	0.81%
ICE 棉花(美分/磅)	79.40	-4.42%	-6.96%
ICE 白糖(美分/磅)	18.37	-2.39%	4.61%

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 19.52%，上周最高 6.737 美元/百万英热单位、最低 5.393 美元/百万英热单位，收于 5.516 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	5.516	-19.52%	-22.42%

数据来源：路透