

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	2
人民币利率市场上周概览	3
人民币信用债市场上周概览	7
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6.7292，较前周升值约2.41%；银行间市场人民币汇率较前周升值约2.22%，上周收于6.7099；1年期掉期点较前周上行396个点，上周收于-1570。
- ✓ 1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周下行1020个点，上周收于6.5635。

● 外币汇率市场上周概览

- ✓ 美元指数较前周下跌1.61%，上周收于102.204。
- ✓ 欧元兑美元较前周上涨1.73%，上周收于1.0828。
- ✓ 美元兑日元较前周下跌3.17%，上周收于127.88。
- ✓ 澳元兑美元较前周上涨1.47%，上周收于0.6976。

● 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1.29%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1.95%附近。
- ✓ 二级市场：10年期国债收益率较前周上行6BP，上周收于2.93%；5年期国债收益率较前周上行7.3BP，上周收于2.85%。
- ✓ 一级市场：财政部招标发行28天、63天、91天、182天期贴现国债，1年、3年、5年、7年期附息国债；农发行招标发行181天、1年、2年、3年、5年、7年期固息债，国开行招标发行90天、1年、3年、5年、7年、10年期固息债，进出口行招标发行90天、1年、2年、3年、5年、7年、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158支，规模合计1477.57亿元；短期融资券26支，规模合计186.7亿元；中期票据56支，规模合计479.36亿元。
- ✓ 二级市场：短期融资券、中期票据、企业债收益率均震荡上行。

● 外币利率市场上周概览（10年期国债）

- ✓ 美国国债价格上涨，收益率较前周下行5.5BP，上周收于3.504%。
- ✓ 德国国债价格上涨，收益率较前周下行4.2BP，上周收于2.168%。

● 贵金属市场上周概览

- ✓ 黄金价格较前周上涨2.92%，上周收于1920.21美元/盎司。
- ✓ 白银价格较前周上涨1.83%，上周收于24.25美元/盎司。
- ✓ 铂金价格较前周下跌2.32%，上周收于1064.76美元/盎司。
- ✓ 钯金价格较前周下跌0.85%，上周收于1789.94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8.53%，上周收于80.32美元/桶。
- ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周上涨8.69%，上周收于85.43美元/桶。

● 基本金属市场上周概览

- ✓ LME3月期铜价格较前周上涨0.24%，上周收于8610.00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2.45%，上周收于1528.50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7.44%，上周收于3.481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（1月13日）报 6.7292，较前周升值约 2.41%。银行间市场人民币汇率较前周升值约 2.22%，上周最高 6.7038、最低 6.8160，收于 6.7099，波幅为 1.67%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五 16:30，1 年期掉期点较前周上行 396 个点，上周最高-425、最低-1880，收于-1570，波幅为 92.68%。
- 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）较前周下行 1020 个点，上周最高 6.6775、最低 6.5528，收于 6.5635，波幅为 1.90%。

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	—	—	6.7292	-1620	-2354	-2354
银行间市场汇价	6.8160	6.7038	6.7099	-1489	-2415	-2415
掉期点						
1 个月期限	-118	-158	-125	27	34	34
2 个月期限	-251	-310	-262	49	67	67
3 个月期限	-161	-516	-422	75	85	85
6 个月期限	-810	-980	-845	185	195	195
1 年期限	-425	-1880	-1570	396	410	410

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	6.8170	6.6829	6.6870	-1215	-2107	-104
2 个月期限	6.8055	6.6716	6.6740	-1205	-2097	-97
3 个月期限	6.7930	6.6576	6.6615	-1195	-2087	-62
6 个月期限	6.7535	6.6207	6.6280	-1130	-2012	26
1 年期限	6.6775	6.5528	6.5635	-1020	-1952	106

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 1.61%，上周最高 103.935、最低 101.988，收于 102.204。
- 欧元兑美元较前周上涨 1.73%，上周最高 1.0867、最低 1.0634，收于 1.0828。
- 美元兑日元较前周下跌 3.17%，上周最高 132.87、最低 127.45，收于 127.88。
- 澳元兑美元较前周上涨 1.47%，上周最高 0.6994、最低 0.6858，收于 0.6976。

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	102.204	-1.61%	-1.27%
欧元/美元	1.0828	1.73%	1.18%
美元/日元	127.88	-3.17%	-2.46%
澳元/美元	0.6976	1.47%	2.39%

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 1.29% 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 1.95% 附近。央行公开市场方面，上周一（1 月 9 日）进行逆回购操作 20 亿元，逆回购到期 430 亿元；上周二（1 月 10 日）进行逆回购操作 10 亿元，逆回购到期 640 亿元；上周三（1 月 11 日）进行逆回购操作 870 亿元，逆回购到期 160 亿元；上周四（1 月 12 日）进行逆回购操作 1170 亿元，逆回购到期 20 亿元；上周五（1 月 13 日）进行逆回购操作 1320 亿元，逆回购到期 20 亿元。本周（2023 年 1 月 16 日-1 月 20 日）将有逆回购到期 1270 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)	1.24	70	-72
7 天 Shibor (1W)	1.94	36	-28
3 月期 Shibor (3M)	2.35	2	-7
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.33	68	-167
7 天回购定盘利率 (FR007)	1.95	20	-105

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，收益率震荡上行。1 年期国债收益率与前周持平，上周收于 2.10%；5 年期国债收益率较前周上行 6BP，上周收于 2.66%；10 年期国债收益率较前周上行 6BP，上周收于 2.93%。
- 政策性金融债方面，收益率震荡上行。1 年期国开债收益率较前周上行 3.9BP，上周收于 2.3%；5 年期国开债收益率较前周上行 7.3BP，上周收于 2.85%；10 年期国开债收益率较前周上行 5BP，上周收于 3.08%。

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	2.10	0	0
3 年期	2.41	3.5	2.5
5 年期	2.66	6.0	5.5
7 年期	2.82	5.0	2.0
10 年期	2.93	6.0	5.5

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	2.30	3.9	6.8
3 年期	2.62	7.4	13.5
5 年期	2.85	7.3	9.5
7 年期	2.96	3.2	1.2
10 年期	3.08	5.0	2.6

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，上周三财政部招标发行 28 天、63 天期贴现国债，3 年、7 年期付息国债；上周五财政部招标发行 91 天、182 天期贴现国债，1 年、5 年期付息国债。
- 政策性金融债方面，上周农发行招标发行 3 年、5 年期固息债。上周二国开行招标发行 90 天、1 年、3 年、5 年期固息债；同日，农发行招标发行 2 年、7 年期固息债。上周三农发行招标发行 181 天、1 年、10 年期固息债。上周四国开行招标发行 3 年、7 年、10 年期固息债；同日，进出口行招标发行 90 天、2 年、3 年、5 年、10 年期固息债。上周五进出口行招标发行 1 年、2 年、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 9BP 至 11BP；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 9BP 至 12BP；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	2.08	9	2
6 月期	2.14	10	5
9 月期	2.20	10	7
1 年期	2.27	10	9
3 年期	2.65	10	11
4 年期	2.78	11	11
5 年期	2.87	11	11
7 年期	3.01	10	11
10 年期	3.16	11	11
3 月 Shibor（ACT/360）			
6 月期	2.44	9	4
9 月期	2.49	10	8
1 年期	2.55	10	9
2 年期	2.77	11	12
3 年期	2.94	11	10
4 年期	3.12	12	12
5 年期	3.26	12	13
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 158 支，规模合计 1477.57 亿元；短期融资券 26 支，规模合计 186.7 亿元；中期票据 56 支，规模合计 479.36 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限波动-3BP 至 4BP。

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
23 蓝星 SCP001	2.58	33D	10.00	AAA	-
23 凯盛科技 SCP001	2.88	45D	10.00	AAA	-
23 融和融资 SCP001(绿色)	2.14	45D	5.00	AAA	-
23 温州城建 SCP001	2.45	60D	3.00	AAA	-
23 水发集团 SCP001	6.60	61D	10.00	AAA	-
23 云建投 SCP002	7.42	65D	10.00	AAA	-
23 苏农垦 SCP001	2.20	68D	10.00	AAA	-
23 中建一局 SCP001(科创票据)	2.05	72D	30.00	AAA	-
23 中兴通讯 SCP004	2.23	77D	10.00	AAA	-
23 中兴通讯 SCP008	2.23	77D	10.00	AAA	-
23 中兴通讯 SCP010	2.23	77D	10.00	AAA	-
23 中兴通讯 SCP011	2.23	77D	5.00	AAA	-
23 中兴通讯 SCP009	2.23	77D	10.00	AAA	-
23 中兴通讯 SCP005	2.23	77D	10.00	AAA	-
23 中兴通讯 SCP007	2.23	77D	10.00	AAA	-
23 中兴通讯 SCP006	2.23	77D	10.00	AAA	-
23 浪潮电子 SCP001(绿色科创)	2.46	86D	10.00	AAA	-
23 厦路桥 SCP001	2.49	90D	5.50	AAA	-
23 中交一公 SCP001	2.15	90D	20.00	AAA	-
23 赣国资 SCP001	2.11	90D	13.00	AAA	-
23 东航股 SCP001	1.93	90D	40.00	AAA	-
23 华电江苏 SCP001	2.17	90D	4.00	AAA	-
23 中交上航 SCP001(科创票据)	1.99	90D	5.00	AAA	-
23 中交投 SCP001	2.28	90D	10.00	AAA	-
23 中建投租 SCP001	2.59	90D	5.00	AAA	-
23 鲁高速 SCP001	2.17	90D	30.00	AAA	-
23 鄂交投 SCP001	2.10	90D	10.00	AAA	-
23 杭州国资 SCP001	2.26	92D	10.00	AAA	-
23 象屿股份 SCP002	2.73	92D	5.00	AAA	-
23 中化股 SCP001	2.04	92D	40.00	AAA	-
23 象屿股份 SCP001	2.68	92D	5.00	AAA	-

23 华能水电 GN002	2.15	93D	10.00	AAA	—
23 长电 SCP003	2.10	100D	25.00	AAA	—
23 长电 SCP004	2.07	100D	25.00	AAA	—
23 长电 SCP005	2.15	130D	25.00	AAA	—
23 长电 SCP002	2.10	130D	25.00	AAA	—
23 中电投 SCP001	1.98	140D	29.00	AAA	—
23 江苏资产 SCP001	2.50	150D	5.00	AAA	—
23 鲁能源 SCP001	2.50	150D	20.00	AAA	—
23 越秀集团 SCP002	2.10	150D	20.00	AAA	—
23 青岛国信 SCP001	2.59	150D	10.00	AAA	—
23 中交建 SCP001	2.18	151D	20.00	AAA	—
23 融和融资 SCP002	2.59	168D	5.00	AAA	—
23 厦翔业 SCP001	2.40	177D	10.00	AAA	—
23 苏州高新 SCP002	2.45	178D	3.00	AAA	—
23 江西交投 SCP001	2.06	178D	15.00	AAA	—
23 深燃气 SCP001	2.09	178D	10.00	AAA	—
23 苏城投 SCP001	2.20	178D	10.00	AAA	—
23 上海机场 SCP001	2.07	179D	20.00	AAA	—
23 兴城投资 SCP001	2.54	179D	10.00	AAA	—
23 招商局 SCP001	2.18	180D	50.00	AAA	—
23 粤海 SCP001	2.14	180D	20.00	AAA	—
23 赣水投 SCP002	2.45	180D	5.00	AAA	—
23 物产中大 SCP001	2.41	180D	15.00	AAA	—
23 中交疏浚 SCP001	2.36	180D	20.00	AAA	—
23 上海机场 SCP003	2.17	180D	10.00	AAA	—
23 浙江机场 SCP001	2.06	180D	8.00	AAA	—
23 赣出版 SCP001	2.40	180D	5.00	AAA	—
23 复星高科 SCP001	6.99	180D	10.00	AAA	—
23 苏城投 SCP002	2.29	180D	10.00	AAA	—
23 广州资管 SCP001	2.54	180D	6.00	AAA	—
23 武钢集 SCP001	2.12	180D	10.00	AAA	—
23 津渤海 SCP002	7.20	180D	6.00	AAA	—
23 津城建 SCP001	6.50	180D	10.00	AAA	—
23 格力 SCP001	2.60	180D	10.00	AAA	—
23 上海机场 SCP002	2.05	180D	10.00	AAA	—
23 厦国贸控 SCP002	2.97	180D	10.00	AAA	—
23 华侨城 SCP001	2.58	180D	15.00	AAA	—
23 华发集团 SCP002	3.81	180D	10.00	AAA	—
23 长春城投 SCP001	6.50	180D	4.90	AAA	—
23 沪国际 SCP001	2.17	182D	10.00	AAA	—
23 苏高新 SCP001	2.52	186D	3.00	AAA	—
23 环球租赁 SCP002	2.81	189D	5.00	AAA	—
23 越秀租赁 SCP001	2.75	195D	8.00	AAA	—
23 青岛国信 SCP002	2.75	210D	15.00	AAA	—

23 泰达投资 SCP001	5.80	210D	4.65	AAA	—
23 平安租赁 SCP001	2.99	226D	10.00	AAA	—
23 济南城建 SCP003	2.65	252D	10.00	AAA	—
23 杭金投 SCP001	2.36	258D	6.00	AAA	—
23 中建材 SCP001	2.11	260D	10.00	AAA	—
23 青岛啤酒 SCP001	2.68	260D	4.00	AAA	—
23 国丰集团 SCP001	2.39	270D	5.00	AAA	—
23 烟台蓝天 SCP001	2.85	270D	10.00	AAA	—
23 天津轨交 SCP001	5.00	270D	10.00	AAA	—
23 渝两江 SCP001	2.63	270D	10.87	AAA	—
23 泉州交通 SCP001	2.77	270D	5.00	AAA	—
23 越秀集团 SCP003	2.22	270D	30.00	AAA	—
23 桂交投 SCP002	2.86	270D	15.00	AAA	—
23 杭城投 SCP001	2.29	270D	12.50	AAA	—
23 左海控股 SCP001	2.54	270D	4.20	AAA	—
23 成都高新 SCP001	2.80	270D	10.00	AAA	—
23 扬城建 SCP002	2.86	270D	3.00	AAA	—
23 温州铁投 SCP001	2.94	270D	5.00	AAA	—
23 湘高速 SCP001	2.53	270D	20.00	AAA	—
23 南通经开 SCP001	3.10	270D	3.00	AAA	—
23 福州地铁 SCP001	2.75	270D	3.00	AAA	—
23 扬城建 SCP001	2.84	270D	10.00	AAA	—
23 桂交投 SCP001	2.78	270D	15.00	AAA	—
23 相城城建 SCP001	2.90	74D	3.70	AA+	—
23 吴中经发 SCP003	2.90	85D	1.50	AA+	—
23 瀚蓝 SCP001	2.29	87D	5.60	AA+	—
23 珠海交通 SCP001	2.63	88D	5.00	AA+	—
23 静安置业 SCP001	2.59	90D	4.50	AA+	—
23 经开国发 SCP002	3.40	90D	2.00	AA+	—
23 淮安新城 SCP001	4.09	90D	1.00	AA+	—
23 鲁商 SCP002	5.80	152D	6.00	AA+	—
23 晋交投 SCP001	2.99	160D	5.00	AA+	—
23 晋交投 SCP002	2.99	160D	5.00	AA+	—
23 连云港 SCP002	4.72	170D	5.00	AA+	—
23 溧阳城建 SCP001	3.65	180D	8.00	AA+	—
23 诚泰租赁 SCP001	4.69	180D	3.00	AA+	—
23 光明房产 SCP001	4.88	180D	6.00	AA+	—
23 亨通 SCP001(科创票据)	6.10	180D	5.00	AA+	—
23 惠山国投 SCP001	3.28	180D	4.00	AA+	—
23 云天化 SCP001(科创票据)	4.66	180D	5.00	AA+	—
23 瀚瑞投资 SCP001	6.40	200D	7.50	AA+	—
23 泰兴城投 SCP002	4.32	210D	4.00	AA+	—
23 嘉秀发展 SCP001	3.10	260D	5.00	AA+	—
23 海沧投资 SCP001	3.98	260D	5.00	AA+	—

23 中兵投资 SCP002	3.10	260D	5.00	AA+	—
23 莫干山 SCP001	3.84	260D	5.00	AA+	—
23 淮北建投 SCP001	5.05	260D	5.00	AA+	—
23 绍兴高新 SCP001	3.59	262D	5.00	AA+	—
23 富阳城投 SCP001	3.00	270D	25.00	AA+	—
23 湖交投 SCP001	3.02	270D	5.00	AA+	—
23 华媒 SCP001	3.04	270D	2.60	AA+	—
23 泰华信 SCP002	4.50	270D	4.00	AA+	—
23 西江 SCP001	4.95	270D	5.00	AA+	—
23 中林集团 SCP001	4.50	270D	5.00	AA+	—
23 荆州城发 SCP001	3.84	270D	5.00	AA+	—
23 张家经开 SCP001	3.10	270D	4.50	AA+	—
23 上饶城投 SCP001	4.90	270D	14.00	AA+	—
23 中兴国资 SCP001	3.80	270D	3.00	AA+	—
23 阜阳投资 SCP001	3.80	270D	10.00	AA+	—
23 先行控股 SCP003	3.63	270D	4.00	AA+	—
23 泉州金控 SCP001	3.50	270D	5.00	AA+	—
23 迈瑞城投 SCP001	5.60	270D	10.00	AA+	—
23 衢通发展 SCP001	3.08	270D	3.00	AA+	—
23 乌经建 SCP001	4.00	270D	5.00	AA+	—
23 伊犁财通 SCP001	3.90	270D	5.00	AA+	—
23 新郑投资 SCP001	4.30	270D	5.00	AA+	—
23 武进经发 SCP001	3.49	270D	5.00	AA+	—
23 先行控股 SCP002	3.64	270D	3.95	AA+	—
23 广东旅控 SCP001	2.53	270D	5.00	AA+	—
23 十堰城发 SCP001	3.90	270D	5.00	AA+	—
23 西盛投资 SCP001	3.95	270D	6.00	AA+	—
23 保利久联 SCP001	4.90	270D	2.00	AA+	—
23 苏科技城 SCP001	3.50	62D	2.00	AA	—
23 天目湖 SCP001	4.25	90D	1.00	AA	—
23 金凤凰 SCP001	3.20	90D	5.00	AA	—
23 镇江旅游 SCP001	5.50	180D	3.10	AA	—
23 龙岩投资 SCP001	4.00	180D	3.00	AA	—
23 湘家荡 SCP001	3.63	260D	2.00	AA	—
23 亳州城建 SCP001	4.42	270D	5.00	AA	—
23 金坛投资 SCP001	4.43	270D	5.00	AA	—
23 合肥高新 SCP001	3.67	270D	5.00	AA	—
23 蚌埠投资 SCP001	5.80	270D	3.00	AA	—
23 连云工投 SCP001	5.50	270D	5.00	AA	—
23 蓝星 SCP001	2.58	33D	10.00	AAA	—
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)		
23 苏农垦 CP001	2.18	64D	3.00	AAA	—
23 津城建 CP001	6.50	180D	20.00	AAA	—

23 华阳新材 CP001	3.68	364D	10.00	AAA	—
23 萧山国资 CP001	2.86	365D	10.00	AAA	—
23 鄂联投 CP001	3.85	365D	10.00	AAA	—
23 海通恒信 CP001	3.41	365D	10.00	AAA	—
23 晋能煤业 CP001	3.40	365D	18.00	AAA	—
23 珠海港股 CP001	2.99	63D	4.00	AA+	—
23 晋交投 CP001	2.99	166D	5.00	AA+	—
23 三门峡 CP001	4.50	182D	4.50	AA+	—
23 良渚文化 CP002	3.29	365D	6.00	AA+	—
23 乐山国资 CP001	3.90	365D	5.00	AA+	—
23 汤山建设 CP001	3.95	365D	9.00	AA+	—
23 胶州湾 CP001	4.90	365D	5.00	AA+	—
23 金阳投资 CP001	5.30	365D	10.00	AA+	—
23 花园 CP001	5.50	365D	5.00	AA+	A-1
23 宜昌城发 CP001	2.90	365D	10.00	AA+	—
23 江阴公 CP001	3.20	365D	5.00	AA+	—
23 高淳建设 CP001	4.13	180D	5.00	AA	—
23 高淳经开 CP001	4.50	180D	5.00	AA	—
23 白马湖 CP001	5.30	365D	5.00	AA	—
23 浦口交通 CP001	3.98	365D	3.00	AA	—
23 景德镇投 CP001	6.90	365D	3.00	AA	A-1
23 黄山城投 CP001	4.10	365D	6.20	AA	—
23 抚州文旅 CP001	5.81	365D	5.00	AA	—
23 宿迁经开 CP001	4.41	365D	5.00	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
23 环球租赁 MTN001	3.62	2.00	5.00	AAA	—
23 华电 MTN001A(能源保供特别债)	3.57	2.00	5.00	AAA	—
23 南昌建投 MTN001	4.25	2.00	11.00	AAA	—
23 华侨城 MTN001	3.36	3.00	15.00	AAA	—
23 江北新区 MTN002	3.95	3.00	10.00	AAA	AAA
23 河钢集 GN001(科创票据)	4.85	3.00	15.00	AAA	AAA
23 华电 MTN001B(能源保供特别债)	3.84	3.00	5.00	AAA	—
23 南昌轨交 MTN001(绿色)	3.56	3.00	10.00	AAA	AAA
23 江北新区 MTN001	3.90	3.00	10.00	AAA	AAA
23 南通经开 MTN001	3.97	3.00	6.00	AAA	—
23 中金集 MTN001	3.14	3.00	30.00	AAA	—
23 大连港 MTN001	3.60	3.00	10.00	AAA	—
23 申迪 MTN001	3.40	3.00	25.00	AAA	AAA
23 青岛城投 MTN001	3.80	3.00	12.00	AAA	—
23 保利置业 MTN001	3.82	3.00	15.00	AAA	—
23 济南城投 MTN001A	3.80	5.00	10.00	AAA	—
23 济南城投 MTN001B	4.10	5.00	5.00	AAA	—
23 吉林高速 MTN001	4.99	5.00	10.00	AAA	AAA

23 重庆交投 MTN001	3.74	5.00	3.26	AAA	—
23 汉江国资 MTN001	4.57	5.00	10.00	AAA	—
23 重庆水务 MTN001	3.55	5.00	9.00	AAA	—
23 铁建房产 MTN001	4.45	5.00	22.00	AAA	—
23 洪山国投 MTN001	5.97	2.00	5.00	AA+	AA+
23 福建漳州 MTN001	4.97	2.00	7.00	AA+	—
23 五新实业 MTN001	4.20	3.00	10.00	AA+	AAA
23 海曙广聚 MTN001	4.06	3.00	10.00	AA+	—
23 徐州经开 MTN001	4.10	3.00	15.00	AA+	AA+
23 柯桥国资 MTN001	3.50	3.00	10.40	AA+	—
23 建安投资 MTN001	4.88	3.00	5.00	AA+	—
23 长春轨交 MTN001	5.80	3.00	10.00	AA+	AA+
23 宿州城投 MTN001	5.50	3.00	5.90	AA+	—
23 武汉车都 MTN001	4.00	3.00	10.00	AA+	—
23 武进经发 MTN001	4.49	3.00	5.00	AA+	—
23 淮北建投 MTN001	6.30	3.00	2.00	AA+	—
23 洛阳城乡 MTN001	4.53	3.00	5.00	AA+	—
23 金霞发展 MTN001	4.28	5.00	5.00	AA+	—
23 兴泸 MTN001	4.20	5.00	6.50	AA+	—
23 宜昌高新 MTN001	5.00	5.00	8.00	AA+	—
23 广州高新 MTN001	4.25	5.00	6.00	AA+	—
23 湖北宏泰 MTN001	4.00	5.00	15.00	AA+	—
23 渝江北嘴 MTN001	3.88	5.00	20.00	AA+	AA+
23 海安经开 MTN001	5.63	1.02	5.30	AA	—
23 泉州台商 MTN001	5.13	2.00	5.00	AA	—
23 南昌金开 MTN001	6.00	2.00	3.00	AA	AA
23 南安市贸 MTN001	5.30	2.00	2.00	AA	—
23 南浔交投 MTN001	5.99	3.00	6.00	AA	—
23 海安动迁 MTN001	5.30	3.00	3.88	AA	—
23 芜湖经开 MTN001	4.00	3.00	4.00	AA	—
23 思明国控 MTN001	5.00	3.00	4.00	AA	—
23 西安陆港 MTN001	6.50	3.00	9.00	AA	AAA
23 鄂州城投 MTN001	5.50	3.00	5.00	AA	—
23 高速地产 MTN001	4.37	3.00	1.32	AA	—
23 宜兴环保 MTN001	4.78	3.00	6.00	AA	—
23 荆门城建 MTN001	5.87	5.00	2.20	AA	—
23 晋江产投 MTN001	5.20	5.00	3.60	AA	AA+
23 桐庐城投 MTN001	4.85	5.00	5.00	AA	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，收益率震荡上行。AAA 级短期融资券中，1 个月品种收益率较前周上行 24BP，上周收于 2.47%；6 个月品种收益率较前周上行 18BP，上周收于 2.63%；1 年期品种收益率较前周上行 4BP，上周收于 2.89%。
- 中期票据方面，收益率震荡上行。AAA 级中期票据中，3 年期品种收益率较前周上行 11BP，上周收于 3.39%；5 年期品种收益率较前周上行 11BP，上周收于 3.56%。
- 企业债方面，收益率震荡上行。AAA 级企业债中，3 年期品种收益率较前周上行 9BP，上周收于 3.18%；5 年期品种收益率较前周上行 4BP，上周收于 3.51%；10 年期品种收益率较前周上行 2BP，上周收于 3.67%。

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格较前周上涨，10 年期美国国债收益率较前周下行 5.5BP，上周收于 3.504%。
- 德国国债价格较前周上涨，10 年期德国国债收益率较前周下行 4.2BP，上周收于 2.168%。

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	4.232	-1.5	-19.4	-19.4
5 年	3.611	-8.7	-39.3	-39.3
10 年	3.504	-5.5	-37.1	-37.1
30 年	3.610	-7.7	-35.3	-35.3
德国国债				
2 年	2.593	1.2	-17.1	-17.1
5 年	2.202	-4.9	-37.6	-37.6
10 年	2.168	-4.2	-40.3	-40.3
30 年	2.134	-2.1	-41.1	-41.1

数据来源：彭博

◆ 外币利率市场上周概览——利率掉期市场

- 美元利率掉期率震荡下行，10 年期美元利率掉期率较前周下行 2.94BP，上周收于 3.4708%。

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	4.4980	-5.58	-21.03	-21.03
10 年	3.4708	-2.94	-36.67	-36.67
30 年	3.2219	-0.62	-26.91	-26.91

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周上涨 2.92%，上周最高 1921.81 美元/盎司、最低 1864.19 美元/盎司，收于 1920.21 美元/盎司。
- 白银价格较前周上涨 1.83%，上周最高 24.29 美元/盎司、最低 23.18 美元/盎司，收于 24.25 美元/盎司。
- 铂金价格较前周下跌 2.32%，上周最高 1102.41 美元/盎司、最低 1044.50 美元/盎司，收于 1064.76 美元/盎司。
- 钯金价格较前周下跌 0.85%，上周最高 1839.54 美元/盎司、最低 1727.00 美元/盎司，收于 1789.94 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	1920.21	2.92%	5.25%
白银	24.25	1.83%	1.19%
铂金	1064.76	-2.32%	-0.45%
钯金	1789.94	-0.85%	-0.21%

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 8.53%，上周最高 80.37 美元/桶、最低 73.79 美元/桶，收于 80.32 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 8.69%，上周最高 85.50 美元/桶、最低 78.43 美元/桶，收于 85.43 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	80.32	8.53%	-0.32%
ICE Brent 主力合约	85.43	8.69%	-0.65%

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 0.24%，上周最高 9240.00 美元/吨、最低 8610.00 美元/吨，收于 8610.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周上涨 0.52%，上周最高 2590.00 美元/吨、最低 2307.50 美元/吨，收于 2307.50 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	8610.00	0.24%	2.84%
LME 3 月铝	2307.50	0.52%	-2.96%

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 2.45%，上周最高 1533.00 美分/蒲式耳、最低 1474.00 美分/蒲式耳，收于 1528.50 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)	743.75	0.10%	-5.97%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1528.50	2.45%	0.28%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	675.80	3.45%	-0.40%
ICE 棉花(美分/磅)	82.41	2.72%	2.72%
ICE 白糖(美分/磅)	19.72	3.95%	-1.65%

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 7.44%，上周最高 4.128 美元/百万英热单位、最低 3.384 美元/百万英热单位，收于 3.481 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	3.481	-7.44%	-21.42%

数据来源：路透