

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6.8717，较前周贬值约0.50%；银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.08%，上周收于6.8713；1年期掉期点较前周下行178个点，上周收于-1753。
- ✓ 1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周下行185个点，上周收于6.7049。

● 外币汇率市场上周概览

- ✓ 美元指数较前周下跌0.59%，上周收于102.506。
- ✓ 欧元兑美元较前周上涨0.74%，上周收于1.0839。
- ✓ 美元兑日元较前周上涨1.61%，上周收于132.79。
- ✓ 澳元兑美元较前周上涨0.60%，上周收于0.6685。

● 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2.22%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2.46%附近。
- ✓ 二级市场：10年期国债收益率较前周下行2.8BP，上周收于2.87%；5年期国开债收益率较前周下行3.5BP，上周收于2.81%。
- ✓ 一级市场：农发行招标发行1年、2年、3年、5年、7年和10年期固息债；国开行招标发行1年、3年、5年、7年、10年和20年期固息债；进出口行招标发行91天期以及1年、2年、3年、3.25年、5年和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131支，规模合计1245.99亿元；短期融资券16支，规模合计137.19亿元；中期票据74支，规模合计594.26亿元。
- ✓ 二级市场：短期融资券、中期票据收益率均区间震荡，企业债收益率震荡下行。

● 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9.1BP，上周收于3.468%。
- ✓ 德国国债价格下跌，收益率较前周上行16.3BP，上周收于2.292%。

● 贵金属市场上周概览

- ✓ 黄金价格较前周下跌0.47%，上周收于1967.90美元/盎司。
- ✓ 白银价格较前周上涨3.66%，上周收于24.07美元/盎司。
- ✓ 铂金价格较前周上涨1.48%，上周收于991.31美元/盎司。
- ✓ 钯金价格较前周上涨3.15%，上周收于1460.24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9.39%，上周收于75.70美元/桶。
- ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周上涨7.13%，上周收于79.93美元/桶。

● 基本金属市场上周概览

- ✓ LME3月期铜价格较前周上涨0.54%，上周收于8993.50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5.28%，上周收于1505.00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6.60%，上周收于2.166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（3月31日）报 6.8717，较前周贬值约 0.50%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.08%，上周最高 6.8435、最低 6.9096，收于 6.8713，波幅为 0.96%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五 16:30，1 年期掉期点较前周下行 178 个点，上周最高-1612、最低-1780，收于-1753，波幅为 9.58%。
- 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 185 个点，上周最高 6.7593、最低 6.6797，收于 6.7049，波幅为 1.19%。

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	—	—	6.8717	343	-802	-929
银行间市场汇价	6.9096	6.8435	6.8713	58	-679	-801
掉期点						
1 个月期限	-170	-196	-173	18	-21	-14
2 个月期限	-190	-389	-361	20	-58	-32
3 个月期限	-161	-569	-533	9	-69	-26
6 个月期限	-992	-1065	-1040	-56	-57	0
1 年期限	-1612	-1780	-1753	-178	132	227

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	6.8870	6.8153	6.8515	90	-462	-25
2 个月期限	6.8733	6.7991	6.8350	85	-487	-2
3 个月期限	6.8570	6.7846	6.8195	78	-507	15
6 个月期限	6.8153	6.7365	6.7760	153	-532	87
1 年期限	6.7593	6.6797	6.7049	-185	-538	89

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 0.59%，上周最高 103.229、最低 102.048，收于 102.506。
- 欧元兑美元较前周上涨 0.74%，上周最高 1.0926、最低 1.0743，收于 1.0839。
- 美元兑日元较前周上涨 1.61%，上周最高 133.59、最低 130.39，收于 132.79。
- 澳元兑美元较前周上涨 0.60%，上周最高 0.6737、最低 0.6631，收于 0.6685。

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	102.506	-0.59%	-2.25%
欧元/美元	1.0839	0.74%	2.49%
美元/日元	132.79	1.61%	-2.50%
澳元/美元	0.6685	0.60%	-0.64%

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 2.22%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 2.46%附近。央行公开市场方面，上周一（3 月 27 日）进行逆回购操作 2550 亿元，逆回购到期 300 亿元；上周二（3 月 28 日）进行逆回购操作 2780 亿元，逆回购到期 1820 亿元；上周三（3 月 29 日）进行逆回购操作 2000 亿元，逆回购到期 670 元；上周四（3 月 30 日）进行逆回购操作 2390 亿元，逆回购到期 640 亿元；上周五进行逆回购操作 1890 亿元，逆回购到期 70 亿元。本周（4 月 3 日-4 月 7 日）将有逆回购到期 11610 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)	1.84	55	-25
7 天 Shibor (1W)	2.22	51	-14
3 月期 Shibor (3M)	2.45	-2	1
隔夜回购定盘利率 (FR001)	2.60	124	40
7 天回购定盘利率 (FR007)	2.70	80	-15

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 6.0BP，上周收于 2.23%；5 年期国债收益率较前周上行 2.0BP，上周收于 2.67%；10 年期国债收益率较前周下行 2.8BP，上周收于 2.87%。
- 政策性金融债方面，收益率震荡下行。1 年期国开债收益率较前周下行 6.9BP，上周收于 2.39%；5 年期国开债收益率较前周下行 3.5BP，上周收于 2.81%；10 年期国开债收益率较前周下行 0.4BP，上周收于 3.03%。

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	2.23	-6.0	-9.6
3 年期	2.50	6.5	1.5
5 年期	2.67	2.0	-3.5
7 年期	2.81	0.0	-2.0
10 年期	2.87	-2.8	-3.8

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	2.39	-6.9	-8.9
3 年期	2.54	-7.0	-17.0
5 年期	2.81	-3.5	-9.5
7 年期	2.98	0.0	-5.3
10 年期	3.03	-0.4	-6.5

数据来源：工商银行

◆ 人民币利率市场上周概览——一级市场

- 政策性金融债方面，上周一农发行招标发行 3 年、5 年期固息债。上周二国开行招标发行 1 年、3 年和 5 年期固息债；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 1 年、10 年期固息债。上周四国开行招标发行 3 年、7 年、10 年和 20 年期固息债；进出口行招标发行 91 天、3 年、5 年和 10 年期固息债。上周五进出口行招标发行 1 年、2 年、3.25 年和 10 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，收益率区间震荡。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下行 2BP 至 5BP；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下行 4BP 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	2.25	-4	-13
6 月期	2.27	-5	-11
9 月期	2.30	-5	-10
1 年期	2.34	-4	-11
3 年期	2.61	-3	-13
4 年期	2.72	-3	-14
5 年期	2.82	-2	-13
7 年期	2.96	-2	-13
10 年期	3.11	-2	-13
3 月 Shibor（ACT/360）			
6 月期	2.48	-6	-4
9 月期	2.52	-6	-9
1 年期	2.59	-6	-12
2 年期	2.78	-6	-15
3 年期	2.93	-6	-16
4 年期	3.09	-4	-16
5 年期	3.21	-4	-17
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 131 支，规模合计 1245.99 亿元；短期融资券 16 支，规模合计 137.19 亿元；中期票据 74 支，规模合计 594.26 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限波动-4BP 至 2BP。

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 华能集 SCP004	2.20	30D	20.00	AAA	—
23 栾川铝业 SCP001(科创票据)	2.48	58D	6.00	AAA	—
23 天成租赁 SCP005	2.38	80D	5.00	AAA	—
23 东航股 SCP002	2.09	86D	20.00	AAA	—
23 深能源 SCP001	2.08	90D	30.00	AAA	—
23 沪机场股 SCP001	2.09	90D	20.00	AAA	—
23 甘肃建设 SCP001	4.98	90D	4.00	AAA	—
23 中交二公 SCP001	2.17	90D	5.00	AAA	—
23 东航股 SCP004	2.08	90D	20.00	AAA	—
23 南航股 SCP001	2.10	90D	21.00	AAA	—
23 东航股 SCP003	2.09	90D	20.00	AAA	—
23 京城建 SCP001	2.10	90D	10.00	AAA	—
23 云建投 SCP005	7.20	90D	10.00	AAA	—
23 中建一局 SCP002(科创票据)	2.20	92D	30.00	AAA	—
23 蒙牛 SCP001	2.10	92D	29.00	AAA	—
23 悦达 SCP004	5.29	99D	5.00	AAA	—
23 国联 SCP009	2.36	101D	3.00	AAA	—
23 国联 SCP010	2.36	101D	3.00	AAA	—
23 杭州国资 SCP002	2.12	105D	10.00	AAA	—
23 恒健 SCP002	2.12	120D	20.00	AAA	—
23 中电路桥 SCP005	2.12	120D	12.00	AAA	—
23 吉利 SCP003	2.25	120D	15.00	AAA	—
23 越秀资本 SCP003	2.32	128D	8.00	AAA	—
23 苏农垦 SCP003	2.45	139D	5.00	AAA	—
23 电网 SCP006	2.14	140D	50.00	AAA	—
23 电网 SCP005	2.14	140D	50.00	AAA	—
23 国联 SCP012	2.35	148D	7.00	AAA	—
23 国联 SCP011	2.35	148D	3.00	AAA	—
23 滨建投 SCP009	6.80	148D	10.00	AAA	—
23 甘国投 SCP002	3.28	150D	5.00	AAA	—
23 云投 SCP011	7.57	150D	15.00	AAA	—

23 龙盛 SCP001 (科创票据)	2.84	150D	8.00	AAA	—
23 甘国投 SCP001	3.38	175D	5.00	AAA	—
23 浙交投 SCP004	2.19	175D	25.00	AAA	—
23 中化工 SCP001	2.21	176D	20.00	AAA	—
23 海尔金控 SCP002	3.72	177D	9.00	AAA	—
23 上海机场 SCP004	2.23	178D	10.00	AAA	—
23 吉利 SCP002	2.60	179D	15.00	AAA	—
23 一汽租赁 SCP001	2.70	179D	5.00	AAA	—
23 南航股 SCP002	2.19	179D	21.00	AAA	—
23 厦国贸控 SCP003	2.67	180D	10.00	AAA	—
23 甘国投 SCP003	3.33	180D	10.00	AAA	—
23 物产中大 SCP004	2.40	180D	15.00	AAA	—
23 陕西金融 SCP001	3.20	180D	5.00	AAA	—
23 滨建投 SCP010	6.92	180D	5.00	AAA	—
23 首都机场 SCP002 (绿色)	2.20	180D	10.00	AAA	—
23 赣粤 SCP003	2.19	180D	9.00	AAA	—
23 赣粤 SCP002	2.19	180D	9.00	AAA	—
23 广州地铁 SCP003	2.19	180D	30.00	AAA	—
23 首都机场 SCP001 (绿色)	2.20	180D	10.00	AAA	—
23 浙交投 SCP005	2.19	180D	10.00	AAA	—
23 武汉城建 SCP003	2.34	180D	5.00	AAA	—
23 云投 SCP010	7.64	180D	9.70	AAA	—
23 河南资产 SCP001	2.69	180D	3.00	AAA	—
23 津城建 SCP018	6.55	200D	12.00	AAA	—
23 潞安 SCP001	2.30	210D	20.00	AAA	—
23 洪市政 SCP002	2.45	210D	10.00	AAA	—
23 津城建 SCP017	6.58	210D	10.00	AAA	—
23 格力电器 GN001	2.29	210D	9.00	AAA	—
23 泰达投资 SCP007	6.95	220D	8.60	AAA	—
23 淄博城运 SCP002	4.05	230D	10.00	AAA	—
23 越秀集团 SCP006	2.23	240D	15.00	AAA	—
23 甬交投 SCP002	2.80	240D	8.00	AAA	—
23 陕建集团 SCP003	4.10	242D	10.00	AAA	—
23 杭金投 SCP004	2.29	263D	8.00	AAA	—
23 西安高新 SCP003	3.47	268D	5.00	AAA	—
23 济南轨交 SCP002	2.55	270D	15.00	AAA	—
23 中车 SCP002	2.23	270D	30.00	AAA	—
23 顺丰泰森 SCP002	2.30	270D	10.00	AAA	—
23 巨石 SCP002	2.39	270D	5.00	AAA	—
23 桂交投 SCP003	2.75	270D	10.00	AAA	—
23 江西交投 SCP003	2.24	270D	12.00	AAA	—
23 浪潮电子 SCP002 (科创票据)	2.37	270D	10.00	AAA	—
23 南京地铁 SCP003	2.35	270D	10.00	AAA	—
23 福州城投 SCP002	2.55	270D	7.80	AAA	—

23 粤海 SCP004	2.23	270D	20.00	AAA	—
23 南山集 SCP001(科创票据)	4.99	270D	5.00	AAA	—
23 烟台蓝天 SCP002	2.45	270D	5.00	AAA	—
23 济南高新 SCP001	3.08	270D	12.00	AAA	—
23 鲁招金 SCP001(科创票据)	2.48	270D	20.00	AAA	—
23 深业 SCP002	2.64	270D	20.00	AAA	—
23 绍兴交投 SCP001	2.80	270D	10.00	AAA	—
23 城发投资 SCP004	4.75	30D	1.50	AA+	—
23 南通高新 SCP003	2.89	71D	5.00	AA+	—
23 杭州热联 SCP003	2.78	90D	5.00	AA+	—
23 亨通 SCP003(科创票据)	5.80	90D	3.00	AA+	—
23 丹投 SCP003	3.45	110D	2.00	AA+	—
23 红豆 SCP001(科创票据)	6.45	120D	5.00	AA+	—
23 城发投资 SCP003	4.70	140D	5.00	AA+	—
23 袍江经开 SCP003	2.78	148D	5.30	AA+	—
23 创元投资 SCP002	2.73	148D	3.00	AA+	—
23 晋交投 SCP005	2.75	160D	3.00	AA+	—
23 杭州热联 SCP002	2.86	160D	10.00	AA+	—
23 鲁商 SCP004	5.80	173D	2.00	AA+	—
23 创元投资 SCP001	2.75	179D	2.00	AA+	—
23 山东公用 SCP001	5.20	180D	2.00	AA+	—
23 海宁皮革 SCP001	2.64	180D	3.00	AA+	—
23 红豆 SCP002(科创票据)	6.50	180D	2.00	AA+	—
23 靖江港口 SCP002	4.30	180D	3.50	AA+	—
23 柯桥开发 SCP002	2.95	180D	7.00	AA+	—
23 天津医药 SCP001	3.30	180D	5.00	AA+	—
23 桐乡城投 SCP001	2.87	180D	5.70	AA+	—
23 宜兴城投 SCP003	2.51	200D	2.50	AA+	—
23 娄城高新 SCP004	2.75	205D	1.10	AA+	—
23 联发集 SCP001	3.40	207D	7.00	AA+	—
23 苏豪 SCP001	2.85	210D	4.00	AA+	—
23 宁夏农垦 SCP002	3.50	210D	2.00	AA+	—
23 盐城高新 SCP003	3.96	269D	1.00	AA+	—
23 宿迁交通 SCP001	2.95	269D	1.00	AA+	—
23 温州现代 SCP002	2.79	270D	4.00	AA+	—
23 温州能源 SCP001	2.90	270D	2.00	AA+	—
23 西盛投资 SCP002	3.30	270D	9.00	AA+	—
23 南京医药 SCP005	2.52	270D	5.00	AA+	—
23 青岛军民 SCP001	3.95	270D	5.00	AA+	—
23 威高 SCP001(科创票据)	4.55	270D	5.00	AA+	—
23 东阳光 SCP002	7.00	270D	2.00	AA+	—
23 青岛金水 SCP001	6.50	270D	5.00	AA+	—
23 广州医药 SCP001	2.59	270D	3.00	AA+	—
23 昆明产投 SCP001	7.00	270D	10.00	AA+	—

23 吴中经发 SCP004	2.94	270D	3.00	AA+	—
23 新水国资 SCP003	2.39	120D	5.00	AA	—
23 新水国资 SCP002	2.39	120D	5.60	AA	—
23 太仓港 SCP002	2.90	138D	1.60	AA	—
23 太仓港 SCP001	2.90	140D	1.50	AA	—
23 闽东百 SCP001	5.35	180D	1.00	AA	—
23 广西林业 SCP002	5.00	230D	1.60	AA	—
23 怀化高新 SCP001	6.20	270D	3.59	AA	—
23 新开元 SCP001	6.00	270D	2.40	AA	—
23 郾国投 SCP001	4.00	270D	7.00	AA	—
23 开封城运 SCP001	6.47	270D	5.00	AA	—
23 怀化城投 SCP001	5.05	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
23 津城建 CP002	6.58	210D	10.00	AAA	—
23 云能投 CP003	4.55	366D	20.00	AAA	—
23 湘高速 CP001	2.31	366D	20.00	AAA	—
23 远东租赁 CP001	4.40	366D	10.00	AAA	—
23 包钢集 CP002	5.20	366D	9.00	AAA	—
23 宜昌城发 CP002	2.98	366D	10.00	AA+	—
23 金桂浆 CP001	5.50	366D	5.00	AA+	—
23 漂水经开 CP002	3.18	366D	3.00	AA+	—
23 株洲高科 CP001	5.20	366D	9.00	AA+	—
23 青岛黄岛 CP001	3.78	366D	7.00	AA+	—
23 胶州城投 CP001	3.95	366D	10.00	AA+	—
23 津南城投 CP001	7.80	366D	10.00	AA+	—
23 盐城交通 CP001	3.10	366D	5.00	AA+	—
23 可克达拉 CP002	3.12	366D	5.00	AA+	—
23 广安 CP001	5.50	366D	2.19	AA	—
23 咸阳城投 CP001	5.00	366D	2.00	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 河南航空 MTN003	5.50	1.01	15.00	AAA	—
23 湘高速 MTN001	2.99	2.00	20.00	AAA	AAA
23 象屿 MTN001	4.10	2.00	23.00	AAA	AAA
23 华发集团 GN001	4.98	2.00	5.00	AAA	AAA
23 中电投 MTN008	3.25	2.00	23.00	AAA	AAA
23 中色 MTN001	3.60	2.00	7.00	AAA	—
23 天安煤业 MTN001(科创票据)	6.28	2.00	7.00	AAA	—
23 首旅 MTN003	3.93	2.00	10.00	AAA	—
23 越秀集团 MTN002	3.05	3.00	20.00	AAA	—
23 华阳新材 MTN006	4.20	3.00	10.00	AAA	—
23 临沂城投 MTN001	4.15	3.00	15.00	AAA	—
23 贵州交通 MTN002	4.85	3.00	5.00	AAA	—

23 潍坊城建 MTN001	5.50	3.00	10.00	AAA	—
23 广州地铁 MTN002	3.01	3.00	25.00	AAA	AAA
23 甘金控 MTN001	4.50	3.00	5.00	AAA	—
23 华润置地 MTN001A	2.80	3.00	30.00	AAA	—
23 赣金控 MTN002	3.90	3.00	6.00	AAA	AAA
23 赣水投 MTN001	3.28	3.00	10.00	AAA	—
23 鄂交投 MTN001	3.68	3.00	10.00	AAA	—
23 宁夏国资 MTN001	3.69	3.00	10.00	AAA	—
23 晋能电力 MTN007	3.85	3.00	10.00	AAA	—
23 首开 MTN003	3.93	5.00	15.00	AAA	—
23 苏州高技 MTN001	3.44	5.00	5.00	AAA	—
23 渝水投 MTN001	3.35	5.00	10.00	AAA	—
23 华润置地 MTN001B	3.39	5.00	10.00	AAA	—
23 浙能源 MTN001	3.28	5.00	10.00	AAA	—
23 西宁城投 MTN001	7.00	2.00	7.00	AA+	—
23 乌经开 MTN002	3.60	2.00	5.00	AA+	—
23 泰华信 MTN001	5.75	2.00	5.10	AA+	—
23 胶州城投 MTN001	4.44	2.00	5.00	AA+	—
23 鲁宏桥 MTN001(绿色)	4.82	2.00	3.00	AA+	AA+
23 华光环保 MTN001(绿色碳资产)	3.10	2.00	4.00	AA+	—
23 中交地产 MTN001	4.07	2.00	10.00	AA+	—
23 淮安新城 MTN001	4.20	2.00	5.20	AA+	—
23 水电五局 MTN001	3.82	2.00	11.00	AA+	AA+
23 连云港 MTN003	6.55	2.00	5.00	AA+	—
23 曲文投 MTN001	6.50	2.00	7.90	AA+	—
23 中广核租 MTN001(蓝色债券)	3.35	3.00	3.16	AA+	AA+
23 温州名城 MTN002	4.33	3.00	7.00	AA+	AAA
23 扬州经开 MTN001	3.78	3.00	5.00	AA+	AA+
23 经开国发 MTN001	3.59	3.00	4.00	AA+	—
23 盐城国投 MTN001	5.50	3.00	10.00	AA+	—
23 芜湖建设 MTN001	3.44	3.00	10.00	AA+	—
23 金鼎产融 MTN001	6.00	3.00	5.00	AA+	—
23 山东公用 MTN001(可持续挂钩)	6.30	3.00	5.00	AA+	AA+
23 通汇投资 MTN001	3.65	3.00	4.50	AA+	AA+
23 淮安投资 MTN001	4.27	3.00	10.00	AA+	—
23 宿州城投 MTN002	4.02	3.00	5.20	AA+	—
23 河南资源 MTN001	3.81	3.00	5.00	AA+	—
23 青岛军民 MTN001	4.80	3.00	5.00	AA+	—
23 邯郸交投 MTN001	4.58	3.00	10.00	AA+	—
23 蓉城文化 MTN001	3.95	3.00	8.00	AA+	AA+
23 镇江城建 MTN002	4.83	3.00	6.00	AA+	—
23 万州经开 MTN001	7.00	5.00	6.00	AA+	—
23 宁经开 MTN001	4.39	5.00	2.50	AA+	AA+
23 长寿投资 MTN001	6.50	5.00	5.00	AA+	—

23 邵阳城投 MTN003	5.83	5.00	2.00	AA+	—
23 福建漳州 MTN003	3.47	5.00	6.00	AA+	—
23 西高投 MTN001	6.50	5.00	2.90	AA-	AAA
23 荆门交旅 MTN001	4.43	1.01	5.20	AA	—
23 东方医药 MTN001	5.99	1.01	1.80	AA	—
23 日照高新 MTN001	4.90	3.00	3.50	AA	AAA
23 绿港 MTN002	7.67	3.00	2.00	AA	—
23 东菱凯琴 MTN001	5.30	3.00	3.00	AA	AA
23 张家建设 MTN001	5.73	3.00	5.00	AA	AA+
23 信阳鼎信 MTN001	4.80	3.00	6.00	AA	AAA
23 潇湘源 MTN001	7.00	3.00	5.00	AA	—
23 马鞍经开 MTN001	6.30	3.00	1.30	AA	—
23 孝感高创 MTN001	5.37	3.00	5.00	AA	—
23 淮南建发 MTN002	4.59	3.00	5.00	AA	—
23 腾海投资 MTN001	5.30	3.00	10.00	AA	—
23 渝豪江 MTN001	6.00	5.00	5.00	AA	AA+
23 达州投资 MTN001	4.94	5.00	7.00	AA	—
23 新安江 MTN001	4.20	5.00	8.00	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上行 5BP，上周收于 2.60%；6 个月品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.66%；1 年期品种收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.78%。
- 中期票据方面，收益率区间震荡。AAA 级中期票据中，3 年期品种收益率较前周下行 10BP，上周收于 3.09%；5 年期品种收益率与前周持平，上周收于 3.34%。
- 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 1.5BP，上周收于 3.08%；5 年期品种收益率较前周下行 5.7BP，上周收于 3.29%；10 年期品种收益率较前周下行 1.8BP，上周收于 3.53%。

◆ 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 9.1BP，上周收于 3.468%。
- 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 16.3BP，上周收于 2.292%。

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	4.025	25.9	-79.1	-40.1
5 年	3.573	16.6	-60.9	-43.1
10 年	3.468	9.1	-45.2	-40.7
30 年	3.650	0.6	-18.6	-31.3
德国国债				
2 年	2.683	29.0	-45.4	-8.1
5 年	2.310	21.1	-43.2	-26.8
10 年	2.292	16.3	-35.9	-27.9
30 年	2.363	14.5	-24.7	-18.2

数据来源：彭博

◆ 外币利率市场上周概览——利率掉期市场

- 美元利率掉期率震荡上行，10 年期美元利率掉期率较前周上行 8.87BP，上周收于 3.4637%。

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	4.3557	26.65	-81.14	-35.26
10 年	3.4637	8.87	-46.99	-37.38
30 年	3.2143	-2.25	-30.83	-27.67

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周下跌 0.47%，上周最高 1987.49 美元/盎司、最低 1943.20 美元/盎司，收于 1967.90 美元/盎司。
- 白银价格较前周上涨 3.66%，上周最高 24.16 美元/盎司、最低 22.80 美元/盎司，收于 24.07 美元/盎司。
- 铂金价格较前周上涨 1.48%，上周最高 996.89 美元/盎司、最低 950.97 美元/盎司，收于 991.31 美元/盎司。
- 钯金价格较前周上涨 3.15%，上周最高 1505.00 美元/盎司、最低 1389.64 美元/盎司，收于 1460.24 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	1967.90	-0.47%	7.70%
白银	24.07	3.66%	15.10%
铂金	991.31	1.48%	4.09%
钯金	1460.24	3.15%	3.05%

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 9.39%，上周最高 75.72 美元/桶、最低 69.13 美元/桶，收于 75.70 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 7.13%，上周最高 79.95 美元/桶、最低 74.39 美元/桶，收于 79.93 美元/桶。

表 12：原油市场主要品种价格变动

品种	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
NYMEX WTI 主力合约	75.70	9.39%	-1.66%
ICE Brent 主力合约	79.93	7.13%	-3.10%

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 0.54%，上周最高 9001.00 美元/吨、最低 8957.00 美元/吨，收于 8993.50 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周上涨 3.11%，上周最高 2417.00 美元/吨、最低 2365.00 美元/吨，收于 2417.00 美元/吨。

表 13：基本金属市场主要品种价格变动

品种	收盘价	较前周（%）	较上月末（%）
LME 3 月铜	8993.50	0.54%	0.15%
LME 3 月铝	2417.00	3.11%	1.90%

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 5.28%，上周最高 1513.75 美分/蒲式耳、最低 1423.25 美分/蒲式耳，收于 1505.00 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

品种	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
CBOT 小麦(美分/蒲式耳)	692.00	0.29%	-2.12%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1505.00	5.28%	1.72%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	658.50	2.17%	4.48%
ICE 棉花(美分/磅)	82.83	8.10%	-1.38%
ICE 白糖(美分/磅)	22.30	7.01%	11.44%

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 6.60%，上周最高 2.299 美元/百万英热单位、最低 2.074 美元/百万英热单位，收于 2.166 美元/百万英热单位。

表 15：天然气市场主要品种价格变动

品种	收盘价	较前周（%）	较上月末（%）
NYMEX 天然气	2.166	-6.60%	-25.03%

数据来源：路透