

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	12
贵金属市场上周概览	14
原油市场上周概览	15
基本金属市场上周概览	16
农产品市场上周概览	17
天然气市场上周概览	18

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7.2150，较前周贬值约0.50%；银行间市场人民币汇率较前周贬值约1.07%，上周收于7.3415；1年期掉期点较前周下行52个点，上周收于-2600。
 - ✓ 1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行832个点，上周收于7.1570。
- **外币汇率市场上周概览**
 - ✓ 美元指数较前周上涨0.82%，上周收于105.090。
 - ✓ 欧元兑美元较前周下跌0.69%，上周收于1.0699。
 - ✓ 美元兑日元较前周上涨1.08%，上周收于147.81。
 - ✓ 澳元兑美元较前周下跌1.16%，上周收于0.6375。
- **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1.89%和2.00%，7天上海银行间同业拆放利率（Shibor）和7天回购定盘利率分别收于1.84%和2.00%。
 - ✓ 二级市场：10年期国债收益率较前周上行6BP，上周收于2.70%；5年期国开债收益率较前周上行6BP，上周收于2.57%。
 - ✓ 一级市场：财政部招标发行28天、63天和91天期贴现国债，5年和30年期付息国债；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1年、2年、3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65支，规模合计647.62亿元；短期融资券15支，规模合计123.80亿元；中期票据70支，规模合计613.61亿元。
 - ✓ 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**
 - ✓ 美国国债价格下跌，10年期美国国债收益率较前周上行8.5BP，上周收于4.264%。
 - ✓ 德国国债价格下跌，10年期德国国债收益率较前周上行6.1BP，上周收于2.610%。
- **贵金属市场上周概览**
 - ✓ 黄金价格较前周下跌1.08%，上周收于1917.81美元/盎司。
 - ✓ 白银价格较前周下跌5.19%，上周收于22.91美元/盎司。
 - ✓ 铂金价格较前周下跌7.07%，上周收于892.64美元/盎司。
 - ✓ 钯金价格较前周下跌1.60%，上周收于1198.24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1.37%，上周收于87.23美元/桶。
 - ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周上涨1.63%，上周收于90.44美元/桶。
- **基本金属市场上周概览**
 - ✓ LME3月期铜价格较前周下跌3.08%，上周收于8230.00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下跌0.33%，上周收于1364.00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5.21%，上周收于2.618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（9月8日）报 7.2150，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 1.07%，上周最高 7.2551、最低 7.3510，收于 7.3415，波幅为 1.31%。
- 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 52 个点，上周最高-2544、最低-2620，收于-2600，波幅为 2.92%。
- 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 832 个点，上周最高 7.1728、最低 7.0447，收于 7.1570，波幅为 1.79%。

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	-	-	7.2150	362	339	2504
银行间市场汇价	7.3510	7.2551	7.3415	782	511	3901
掉期点						
1 个月期限	-80	-241	-197	40	43	-38
2 个月期限	-419	-445	-425	13	15	-96
3 个月期限	-638	-670	-643	13	11	-136
6 个月期限	-1300	-1360	-1313	-2	7	-273
1 年期限	-2544	-2620	-2600	-52	-33	-620

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	7.2715	7.1839	7.2585	577	3608	-633
2 个月期限	7.2855	7.1930	7.2700	607	3863	-290
3 个月期限	7.2840	7.1853	7.2705	677	4003	-67
6 个月期限	7.2600	7.1474	7.2450	797	4158	348
1 年期限	7.1728	7.0447	7.1570	832	3983	757

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 0.82%，上周最高 105.157、最低 104.025，收于 105.090。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.69%，上周最高 1.0808、最低 1.0685，收于 1.0699。
- 美元兑日元较前周上涨 1.08%，上周最高 147.87、最低 146.00，收于 147.81。
- 澳元兑美元较前周下跌 1.16%，上周最高 0.6480、最低 0.6355，收于 0.6375。

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	105.090	0.82%	1.42%
欧元/美元	1.0699	-0.69%	-1.31%
美元/日元	147.81	1.08%	1.57%
澳元/美元	0.6375	-1.16%	-1.67%

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 1.89%和 2.00%，7 天上海银行间同业拆放利率（Shibor）和 7 天回购定盘利率分别收于 1.84%和 2.00%。央行公开市场方面，上周一（9 月 4 日）进行逆回购操作 120 亿元，逆回购到期 3320 亿元；上周二（9 月 5 日）进行逆回购操作 140 亿元，逆回购到期 3850 亿元；上周三（9 月 6 日）进行逆回购操作 260 亿元，逆回购到期 3820 亿元；上周四（9 月 7 日）进行逆回购操作 3300 亿元，逆回购到期 2090 亿元；上周五进行逆回购操作 3630 亿元，逆回购到期 1010 亿元。本周（9 月 11 日-9 月 15 日）将有逆回购到期 7450 亿元和中期借贷便利（MLF）到期 4000 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)	1.89	21	3
7 天 Shibor (1W)	1.84	3	-27
3 月期 Shibor (3M)	2.08	4	4
隔夜回购定盘利率 (FR001)	2.00	24	-36
7 天回购定盘利率 (FR007)	2.00	5	-28

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 年期国债收益率较前周上行 14BP，上周收于 2.10%；5 年期国债收益率较前周上行 6BP，上周收于 2.48%；10 年期国债收益率较前周上行 6BP，上周收于 2.70%。
- 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 12BP，上周收于 2.21%；5 年期国开债收益率较前周上行 6BP，上周收于 2.57%；10 年期国开债收益率较前周上行 5BP，上周收于 2.86%。

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	14	19
3 年期	2.33	9	11
5 年期	2.48	6	10
7 年期	2.60	7	11
10 年期	2.70	6	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	2.21	12	14
3 年期	2.32	10	13
5 年期	2.57	6	11
7 年期	2.74	9	12
10 年期	2.86	5	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，上周三财政部发行 28 天和 63 天期贴现国债，5 年期付息国债。上周五财政部发行 91 天期贴现国债和 30 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 年和 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 年和 7 年期固息债。上周三农发行招标发行 1 年、3 年和 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 3 年、5 年和 10 年期固息债。上周五进出口行招标发行 1 年和 2 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，收益率震荡下行。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震荡上行 0BP 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震荡上行 7BP 至 10BP；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 1.65%；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 1.77%。

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	2.04	11	11
6 月期	2.06	11	12
9 月期	2.05	9	11
1 年期	2.05	8	10
3 年期	2.26	7	11
4 年期	2.37	6	11
5 年期	2.48	6	11
7 年期	2.50	0	0
10 年期	2.65	0	0
3 月 Shibor（ACT/360）			
6 月期	2.22	8	10
9 月期	2.25	9	12
1 年期	2.27	10	13
2 年期	2.38	9	13
3 年期	2.50	8	13
4 年期	2.64	7	13
5 年期	2.77	7	13
1 年 Depo（ACT/365）			
2 年期	1.65	0	0
3 年期	1.77	0	0
4 年期	1.80	0	0
5 年期	1.80	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 65 支，规模合计 647.62 亿元；短期融资券 15 支，规模合计 123.80 亿元；中期票据 70 支，规模合计 613.61 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限震荡-6BP 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 SCP017	1.89	37D	40.00	AAA	-
23 华能江苏 SCP003(科创票据)	2.00	45D	3.00	AAA	-
23 中车 SCP005	2.05	60D	30.00	AAA	-
23 中车 SCP006	2.05	60D	30.00	AAA	-
23 沪电力 SCP017	2.14	79D	10.00	AAA	-
23 中电路桥 SCP009	2.14	85D	8.00	AAA	-
23 兴业资产 SCP002	2.30	86D	10.00	AAA	-
23 东航股 SCP011	2.07	90D	25.00	AAA	-
23 晋能装备 SCP002(科创票据)	2.20	90D	20.00	AAA	-
23 江苏广电 SCP007(科创票据)	2.12	90D	5.00	AAA	-
23 中机公司 SCP001	2.50	90D	10.00	AA+	-
23 昆山文商 SCP005(绿色)	2.50	90D	0.40	AA	-
23 夏商 SCP008	2.28	94D	5.00	AA+	-
23 苏交通 SCP019	2.12	100D	20.00	AAA	-
23 首钢股份 SCP002	2.21	105D	10.00	AAA	-
23 津城建 SCP061	2.89	110D	16.00	AAA	-
23 国药控股 SCP005	2.20	111D	30.00	AAA	-
23 绍兴城投 SCP002	2.30	115D	5.00	AAA	-
23 绍兴城投 SCP001	2.20	115D	5.00	AAA	-
23 中建交通 SCP004(科创票据)	3.00	115D	3.00	AA	-
23 国药租赁 SCP001	2.43	150D	5.00	AAA	-
23 云投 SCP033	5.30	167D	10.00	AAA	-
23 云投 SCP032	5.50	170D	20.00	AAA	-
23 天成租赁 SCP016	2.35	170D	10.00	AAA	-
23 广州地铁 SCP010	2.22	180D	20.00	AAA	-
23 浙交投 SCP011	2.17	180D	10.00	AAA	-
23 浙交投 SCP012	2.17	180D	10.00	AAA	-
23 龙盛 SCP010(科创票据)	2.52	180D	5.00	AAA	-
23 凤凰传媒 SCP002	2.19	180D	5.00	AAA	-
23 甘国投 SCP008	2.69	180D	5.00	AAA	-
23 云铁投 SCP003	5.48	180D	10.00	AA+	-

23 赣建工 SCP001(科创票据)	3.90	180D	6.00	AA+	—
23 云南水利 SCP003	6.15	180D	5.00	AA+	—
23 福建港口 SCP006	2.15	190D	10.00	AAA	—
23 越秀租赁 SCP009	2.45	220D	6.00	AAA	—
23 经开国发 SCP009	2.52	224D	1.00	AA+	—
23 武清国资 SCP005	4.00	245D	10.00	AA+	—
23 海通恒信 SCP006	2.50	263D	10.00	AAA	—
23 红狮 SCP005	2.55	265D	5.00	AAA	—
23 平湖国资 SCP002	2.50	266D	6.00	AA+	—
23 华电租赁 SCP007	2.45	268D	5.00	AAA	—
23 宜昌高新 SCP001	2.82	268D	5.00	AA+	—
23 兴化城投 SCP003	3.30	269D	2.30	AA	—
23 广州地铁 SCP011	2.31	270D	20.00	AAA	—
23 粤珠江 SCP006	2.65	270D	20.00	AAA	—
23 粤珠江 SCP008	3.00	270D	16.00	AAA	—
23 深燃气 SCP008	2.26	270D	15.00	AAA	—
23 渝两江 SCP005	2.31	270D	14.42	AAA	—
23 新矿集团 SCP001	2.55	270D	10.00	AAA	—
23 成都高新 SCP003	2.38	270D	10.00	AAA	—
23 复星高科 SCP003	5.16	270D	10.00	AAA	—
23 滨建投 SCP026	3.59	270D	8.00	AAA	—
23 江苏资产 SCP010	2.45	270D	5.00	AAA	—
23 扬子国资 SCP003	2.24	270D	5.00	AAA	—
23 武汉城建 SCP009	2.44	270D	4.00	AAA	—
23 华宝都鼎 SCP003	2.45	270D	3.00	AAA	—
23 温州铁投 SCP004	2.28	270D	1.50	AAA	—
23 武清国资 SCP004	4.00	270D	10.00	AA+	—
23 柯桥开发 SCP004	2.55	270D	7.00	AA+	—
23 曲江金融 SCP002	4.50	270D	5.00	AA+	—
23 浙江旅投 SCP002	2.57	270D	5.00	AA+	—
23 渝医药 SCP009	2.97	270D	5.00	AA+	—
23 瘦西湖 SCP006	2.60	270D	3.00	AA+	—
23 易鑫租赁 SCP004	4.80	270D	2.00	AA+	—
23 江苏粮食 SCP001	2.48	270D	2.00	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 桂交投 CP006	2.49	300D	9.00	AAA	—
23 津城建 CP015	4.00	366D	15.00	AAA	—
23 津城建 CP014	3.60	366D	15.00	AAA	—
23 宁河西 CP002	2.52	366D	7.00	AAA	—
23 苏州资产 CP001	2.64	366D	6.00	AAA	—
23 十堰城发 CP001	2.94	366D	10.00	AA+	—
23 邹城资产 CP001	7.20	366D	10.00	AA+	—
23 黄石城发 CP004	3.79	366D	10.00	AA+	—

23 麓山投资 CP001	2.45	366D	8.80	AA+	—
23 衡阳高新 CP001	3.35	366D	7.00	AA+	—
23 新郑投资 CP002	3.16	366D	5.00	AA+	—
23 市政集团 CP001(科创票据)	2.49	366D	3.00	AA+	—
23 青岛黄岛 CP002	3.00	366D	3.00	AA+	—
23 合川投资 CP002	3.70	366D	10.00	AA	—
23 黄石众邦 CP002	4.00	366D	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 武金控 MTN004	3.98	1.15	6.00	AAA	—
23 荆门交旅 MTN002	4.07	1.50	4.30	AA	—
23 华能 MTN014	3.05	2.00	20.00	AAA	AAA
23 中电投 MTN037(能源保供特别债)	2.98	2.00	20.00	AAA	AAA
23 平安租赁 MTN004	3.49	2.00	15.00	AAA	—
23 晋能煤业 MTN005	3.60	2.00	15.00	AAA	AAA
23 大唐陕西 MTN003	3.60	2.00	5.00	AAA	—
23 天津轨交 MTN003	3.80	2.00	5.00	AAA	—
23 海发宝诚 MTN002(绿色)	3.56	2.00	5.00	AAA	AAA
23 美的置业 MTN004B	4.60	2.00	5.00	AAA	AAA
23 美的置业 MTN004C	4.85	2.00	5.00	AAA	AAA
23 西海公用 MTN001	3.43	2.00	5.00	AA+	—
23 武汉旅游 MTN002	4.04	2.00	5.00	AA+	AA+
23 衡高控股 MTN001	4.15	2.00	3.00	AA+	—
23 水利三 MTN001	3.64	2.00	3.00	AA+	AA+
23 新余城建 MTN002A	3.83	2.00	6.00	AA	—
23 昆明经开 MTN002	7.50	2.00	5.00	AA	AA+
23 深能源 MTN001	3.17	3.00	30.00	AAA	AAA
23 核能电力 MTN002	2.68	3.00	30.00	AAA	AAA
23 光大控股 MTN002	3.60	3.00	20.00	AAA	AAA
23 苏交通 MTN004	2.69	3.00	20.00	AAA	—
23 中建八局 MTN001(科创票据)	3.15	3.00	20.00	AAA	AAA
23 首机场股 MTN001	3.06	3.00	15.00	AAA	—
23 西咸新发 MTN003	3.70	3.00	15.00	AAA	—
23 上实 MTN002A	2.75	3.00	12.00	AAA	—
23 华阳新材 MTN012	5.70	3.00	10.00	AAA	—
23 中原豫资 MTN002	3.16	3.00	10.00	AAA	—
23 中冶 MTN013	3.22	3.00	10.00	AAA	AAA
23 甬开投 MTN002	2.95	3.00	10.00	AAA	—
23 中冶 MTN012	3.10	3.00	10.00	AAA	AAA
23 绿城房产 MTN001(绿色)	4.31	3.00	10.00	AAA	AAA
23 甘公投 MTN005	4.28	3.00	7.00	AAA	—
23 川高速 MTN006(革命老区)	3.30	3.00	7.00	AAA	—
23 美的置业 MTN004A	3.40	3.00	5.00	AAA	AAA
23 宁河西 MTN002A	3.01	3.00	4.00	AAA	—

23 淮安国投 MTN004	3.43	3.00	2.00	AAA	—
23 常德城投 MTN002	3.75	3.00	15.00	AA+	—
23 西永电子 MTN003	3.70	3.00	15.00	AA+	—
23 中国建设 MTN001	3.44	3.00	12.00	AA+	AA+
23 甘肃能化 MTN001	3.90	3.00	10.00	AA+	—
23 平度城投 MTN003	3.35	3.00	10.00	AA+	—
23 开滦股 MTN001	3.31	3.00	6.00	AA+	—
23 商丘发展 MTN001	4.35	3.00	6.00	AA+	—
23 郑州公用 MTN002	3.05	3.00	6.00	AA+	—
23 山西文旅 MTN003	5.60	3.00	5.00	AA+	—
23 义乌国资 MTN003	3.80	3.00	5.00	AA+	AA+
23 泉州水务 MTN002	3.04	3.00	5.00	AA+	—
23 空港兴城 MTN001	3.18	3.00	5.00	AA+	—
23 西青经开 MTN001	4.98	3.00	3.60	AA+	AA+
23 柳州东投 MTN001	7.50	3.00	3.00	AA+	—
23 萍乡投发 MTN002	4.50	3.00	2.10	AA+	—
23 菲达环保 GN001(科创票据)	3.45	3.00	2.00	AA+	—
23 即墨旅投 MTN003	3.45	3.00	1.40	AA+	—
23 新天投资 MTN001	5.90	3.00	11.00	AA	AA+
23 三明高速 MTN001(革命老区)	3.40	3.00	4.00	AA	—
23 思明国控 MTN004	3.47	3.00	4.00	AA	—
23 新余城建 MTN002B	4.70	3.00	3.00	AA	—
23 中国燃气 MTN001(乡村振兴)	3.15	5.00	15.00	AAA	—
23 深圳高速 MTN002	3.05	5.00	10.00	AAA	AAA
23 上实 MTN002B	3.24	5.00	3.00	AAA	—
23 宁河西 MTN002B	3.34	5.00	3.00	AAA	—
23 郴投集团 MTN001	4.28	5.00	10.00	AA+	—
23 延安新投 MTN001	5.70	5.00	10.00	AA+	—
23 黄冈城投 MTN005	3.22	5.00	7.00	AA+	—
23 大庆城投 MTN001	6.20	5.00	2.00	AA+	—
23 达州高科 MTN001	4.50	5.00	10.00	AA	AA+
23 广安 MTN001	5.50	5.00	8.51	AA	AA+
23 寿光金鑫 MTN001	7.00	5.00	6.00	AA	—
23 璧山城投 MTN001	4.20	5.00	5.70	AA	—
23 浙能源 MTN003	3.17	10.00	10.00	AAA	AAA

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 22BP，上周收于 2.32%；6 个月品种收益率较前周上行 16BP，上周收于 2.40%；1 年期品种收益率较前周上行 13BP，上周收于 2.58%。
- 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 19BP，上周收于 3.12%；5 年期品种收益率较前周上行 20BP，上周收于 3.41%。
- 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 19BP，上周收于 2.93%；5 年期品种收益率较上周上行 15BP，上周收于 3.08%；10 年期品种收益率较前周上行 10BP，上周收于 3.24%。

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格下跌，10 年期美国国债收益率较前周上行 8.5BP，上周收于 4.264%。
- 德国国债价格下跌，10 年期德国国债收益率较前周上行 6.1BP，上周收于 2.610%。

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	4.991	11.2	12.8	56.5
5 年	4.403	10.7	14.9	39.9
10 年	4.264	8.5	15.6	38.9
30 年	4.338	4.4	12.7	37.5
德国国债				
2 年	3.081	9.1	10.3	31.7
5 年	2.615	8.8	13.8	3.7
10 年	2.610	6.1	14.4	3.9
30 年	2.735	5.3	14.4	19.0

数据来源：彭博

◆ 外币利率市场上周概览——利率掉期市场

- 美元利率掉期率上行，10 年期美元利率掉期率较前周上行 8.50BP，上周收于 3.9750%。

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	4.8850	11.20	11.81	43.90
10 年	3.9750	8.50	14.76	41.75
30 年	3.6690	5.10	12.80	46.05

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周下跌 1.08%，上周最高 1946.09 美元/盎司、最低 1914.00 美元/盎司，收于 1917.81 美元/盎司。
- 白银价格较前周下跌 5.19%，上周最高 24.29 美元/盎司、最低 22.82 美元/盎司，收于 22.91 美元/盎司。
- 铂金价格较前周下跌 7.07%，上周最高 963.31 美元/盎司、最低 889.18 美元/盎司，收于 892.64 美元/盎司。
- 钯金价格较前周下跌 1.60%，上周最高 1232.93 美元/盎司、最低 1179.74 美元/盎司，收于 1198.24 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	1917.81	-1.08%	-1.13%
白银	22.91	-5.19%	-6.25%
铂金	892.64	-7.07%	-7.74%
钯金	1198.24	-1.60%	-1.35%

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 1.37%，上周最高 88.08 美元/桶、最低 85.02 美元/桶，收于 87.23 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 1.63%，上周最高 91.15 美元/桶、最低 88.06 美元/桶，收于 90.44 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	87.23	1.37%	4.37%
ICE Brent 主力合约	90.44	1.63%	4.17%

数据来源：路透

◆ 基本金属市场上周概览

- LME3 月期铜价格较前周下跌 3.08%，上周最高 8491.50 美元/吨、最低 8230.00 美元/吨，收于 8230.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周下跌 2.50%，上周最高 2237.00 美元/吨、最低 2181.00 美元/吨，收于 2181.00 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	8230.00	-3.08%	-2.45%
LME 3 月铝	2181.00	-2.50%	-0.93%

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下跌 0.33%，上周最高 1384.75 美分/蒲式耳、最低 1352.50 美分/蒲式耳，收于 1364.00 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)	595.25	-0.04%	-13.98%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1364.00	-0.33%	-0.26%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	483.00	0.05%	-5.71%
ICE 棉花(美分/磅)	86.01	-4.43%	-1.87%
ICE 白糖(美分/磅)	26.40	2.09%	9.36%

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 5.21%，上周最高 2.708 美元/百万英热单位、最低 2.500 美元/百万英热单位，收于 2.618 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	2.618	-5.21%	-5.28%

数据来源：路透