

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7.1729,较前周升值约0.08%;银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.43%,上周收于7.3002;1年期掉期点较前周下行80个点,上周收于-2640。
 - ✓ 1年期境外美元对人民币无本金交割远期(NDF)较前周上行185个点,上周收于7.1230。
- **外币汇率市场上周概览**
 - ✓ 美元指数较前周上涨0.25%,上周收于105.583。
 - ✓ 欧元兑美元较前周下跌0.03%,上周收于1.0652。
 - ✓ 美元兑日元较前周上涨0.37%,上周收于148.37。
 - ✓ 澳元兑美元较前周上涨0.14%,上周收于0.6441。
- **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1.73%和1.80%,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1.99%附近。
 - ✓ 二级市场:10年期国债收益率较前周上行4BP,上周收于2.72%;5年期国债收益率较前周上行3BP,上周收于2.58%。
 - ✓ 一级市场:财政部招标发行91天和182天期贴现国债,以及1年、2年、5年和10年期附息国债。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、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101支,规模合计818.43亿元;短期融资券17支,规模合计106.74亿元;中期票据82支,规模合计813.60亿元。
 - ✓ 二级市场:短期融资券收益率震荡上行、中期票据收益率震荡下行、企业债收益率小幅震荡。
- **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10.1BP,上周收于4.434%。
 - ✓ 德国国债价格下跌,10年期德国国债收益率较前周上行6.4BP,上周收于2.739%。
- **贵金属市场上周概览**
 - ✓ 黄金价格较前周上涨0.07%,上周收于1924.99美元/盎司。
 - ✓ 白银价格较前周上涨2.27%,上周收于23.53美元/盎司。
 - ✓ 铂金价格较前周上涨0.14%,上周收于926.32美元/盎司。
 - ✓ 钯金价格较前周上涨0.05%,上周收于1249.14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0.08%,上周收于90.33美元/桶。
 - ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周下跌1.01%,上周收于92.43美元/桶。
- **基本金属市场上周概览**
 - ✓ LME3月期铜价格较前周下跌2.50%,上周收于8198.50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下跌3.23%,上周收于1295.25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1.33%,上周收于2.888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22日）报7.1729，较前周升值约0.08%。截至上周五16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.43%，上周最高7.2757、最低7.3108，收于7.3002，波幅为0.48%。
- 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80个点，上周最高-2535、最低-2655，收于-2640，波幅为4.55%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：截至上周五17:00，1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行185个点，上周最高7.1430、最低7.0960，收于7.1230，波幅为0.66%。

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	-	-	7.1729	-57	-82	2083
银行间市场汇价	7.3108	7.2757	7.3002	311	98	3488
掉期点						
1 个月期限	-186	-220	-194	6	46	-35
2 个月期限	-411	-432	-418	2	22	-89
3 个月期限	-612	-646	-625	12	29	-118
6 个月期限	-1264	-1305	-1285	4	35	-245
1 年期限	-2535	-2655	-2640	-80	-73	-660

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	7.2355	7.1967	7.2090	-62	2770	-718
2 个月期限	7.2495	7.2082	7.2235	55	3055	-349
3 个月期限	7.2505	7.2085	7.2260	75	3220	-117
6 个月期限	7.2235	7.1805	7.2020	115	3388	303
1 年期限	7.1430	7.0960	7.1230	185	3300	868

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 0.25%，上周最高 105.782、最低 104.665，收于 105.583。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.03%，上周最高 1.0736、最低 1.0613，收于 1.0652。
- 美元兑日元较前周上涨 0.37%，上周最高 148.45、最低 147.31，收于 148.37。
- 澳元兑美元较前周上涨 0.14%，上周最高 0.6511、最低 0.6383，收于 0.6441。

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	105.583	0.25%	1.90%
欧元/美元	1.0652	-0.03%	-1.74%
美元/日元	148.37	0.37%	1.95%
澳元/美元	0.6441	0.14%	-0.65%

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 1.73%和 1.80%，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 1.99%附近。央行公开市场方面，上周一（9 月 18 日）进行逆回购操作 2440 亿元和国库现金定存操作 500 亿元，逆回购到期 2150 亿元；上周二（9 月 19 日）进行逆回购操作 2680 亿元，逆回购到期 2090 亿元；上周三（9 月 20 日）进行逆回购操作 2910 亿元，逆回购到期 650 亿元；上周四（9 月 21 日）进行逆回购操作 2510 亿元，逆回购到期 1100 亿元和国库现金定存到期 500 亿元；上周五进行逆回购操作 2020 亿元，逆回购到期 1050 亿元。本周（9 月 25 日-9 月 28 日）将有逆回购到期 7660 亿元和央行票据互换到期 50 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)	1.73	-4	-14
7 天 Shibor (1W)	1.99	9	-12
3 月期 Shibor (3M)	2.27	11	23
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.80	-4	-56
7 天回购定盘利率 (FR007)	2.00	0	-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7BP，上周收于2.20%；5年期国债收益率较前周上行4BP，上周收于2.50%；10年期国债收益率较前周上行4BP，上周收于2.72%。
- 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5BP，上周收于2.28%；5年期国开债收益率较前周上行3BP，上周收于2.58%；10年期国开债收益率较前周上行2BP，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	2.20	7	29
3年期	2.35	4	13
5年期	2.50	4	12
7年期	2.63	4	13
10年期	2.72	4	10

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	2.28	5	21
3年期	2.36	6	17
5年期	2.58	3	11
7年期	2.74	2	12
10年期	2.86	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，上周三财政部招标发行 1 年和 10 年期付息国债，上周五财政部招标发行 91 天和 182 天期贴现国债，以及 2 年和 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 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、3 年和 7 年期固息债。上周三农发行招标发行 1 年和 10 年期固息债。上周四国开行招标发行 3 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震荡上行 0BP 至 2BP；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区间波动-1BP 至 5BP；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	2.05	2	12
6 月期	2.04	1	10
9 月期	2.03	1	9
1 年期	2.03	1	8
3 年期	2.25	1	10
4 年期	2.36	0	10
5 年期	2.47	1	10
7 年期	2.49	1	-1
10 年期	2.64	1	-1
3 月 Shibor (ACT/360)			
6 月期	2.30	5	18
9 月期	2.27	1	14
1 年期	2.26	0	12
2 年期	2.35	-1	10
3 年期	2.48	0	11
4 年期	2.61	-1	10
5 年期	2.74	-1	10
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 101 支，规模合计 818.43 亿元；短期融资券 17 支，规模合计 106.74 亿元；中期票据 82 支，规模合计 813.60 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限上行 1BP 至 9BP。

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 大唐发电 SCP006	2.46	35D	10.00	AAA	-
23 津城建 SCP062	3.19	45D	15.00	AAA	-
23 南通沿海 SCP009	2.55	75D	10.00	AAA	-
23 苏州高新 SCP026	2.50	80D	4.00	AAA	-
23 一汽租赁 SCP005	2.40	87D	5.00	AAA	-
23 浙江机场 SCP004	2.26	88D	10.00	AAA	-
23 鲁高速股 SCP007	2.41	88D	10.00	AAA	-
23 苏交通 SCP020	2.32	90D	25.00	AAA	-
23 吉利 SCP006	2.51	90D	20.00	AAA	-
23 鲁高速 SCP004	2.28	90D	20.00	AAA	-
23 国盛 SCP007	2.23	90D	6.00	AAA	-
23 杭州热联 SCP006	2.79	90D	5.00	AA+	-
23 闽东百 SCP002	5.20	90D	1.00	AA	-
23 东航 SCP009	2.14	91D	20.00	AAA	-
23 一汽租赁 SCP006	2.48	91D	5.00	AAA	-
23 苏州高新 SCP027	2.53	93D	2.00	AAA	-
23 首旅 SCP010	2.34	97D	9.00	AAA	-
23 首旅 SCP011	2.34	97D	8.00	AAA	-
23 首旅 SCP012	2.34	97D	8.00	AAA	-
23 中交三公 SCP002	2.67	99D	5.00	AA+	-
23 中拓 SCP008	2.65	100D	5.00	AA+	-
23 苏州港 SCP003	2.57	112D	3.00	AA+	-
23 新华报业 SCP007	2.48	115D	2.50	AA+	-
23 苏交通 SCP021	2.36	120D	20.00	AAA	-
23 相城城建 SCP004	2.69	120D	4.50	AA+	-
23 龙源电力 SCP014	2.31	136D	35.00	AAA	-
23 云建投 SCP021 (科创票据)	5.15	160D	10.00	AAA	-
23 云建投 SCP020 (科创票据)	5.18	160D	10.00	AAA	-
23 豫园商城 SCP002	5.30	175D	6.00	AAA	-
23 云投 SCP035	5.08	180D	20.00	AAA	-
23 赣粤 SCP005	2.24	180D	15.00	AAA	-

23 水发集团 SCP008	4.90	180D	15.00	AAA	-
23 泰达投资 SCP014	5.20	180D	10.30	AAA	-
23 陕建集团 SCP008 (科创票据)	4.04	180D	10.00	AAA	-
23 广州地铁 SCP015	2.37	180D	10.00	AAA	-
23 广州地铁 SCP014	2.35	180D	10.00	AAA	-
23 杭州热联 SCP007	2.98	180D	10.00	AA+	-
23 新水国资 SCP008	2.86	180D	6.00	AA+	-
23 龙盛 SCP012 (科创票据)	2.74	180D	5.00	AAA	-
23 赣出版 SCP005	2.41	180D	5.00	AAA	-
23 河南资产 SCP002	2.69	180D	5.00	AAA	-
23 天津医药 SCP002	2.75	180D	5.00	AA+	-
23 武进经发 SCP009	2.79	180D	4.90	AA+	-
23 通商租赁 SCP009 (绿色)	2.43	182D	5.00	AAA	-
23 环球租赁 SCP015	2.59	185D	6.00	AAA	-
23 京电子城 SCP003	3.35	190D	5.50	AA	-
23 福高国资 SCP002	2.88	195D	1.00	AA+	-
23 济南城建 SCP011	2.55	197D	10.00	AAA	-
23 桐乡城投 SCP003	2.73	202D	5.70	AA+	-
23 滨建投 SCP030	3.75	210D	10.00	AAA	-
23 通商租赁 SCP010	2.44	214D	5.00	AAA	-
23 湘高速 SCP007	2.47	220D	20.00	AAA	-
23 新海连 SCP003	3.02	242D	6.00	AA+	-
23 海发宝诚 SCP007	2.95	243D	8.00	AAA	-
23 青岛国信 SCP007	2.63	255D	15.00	AAA	-
23 海通恒信 SCP007	2.68	261D	10.00	AAA	-
23 平湖国资 SCP003	2.72	265D	6.00	AA+	-
23 海沧投资 SCP011	2.93	266D	5.00	AA+	-
23 格力 SCP015	2.54	267D	10.00	AAA	-
23 滨建投 SCP029	3.80	268D	12.00	AAA	-
23 鲁商 SCP014	5.60	269D	4.00	AA+	-
23 广州地铁 SCP013	2.38	270D	20.00	AAA	-
23 吉利 SCP007	2.64	270D	15.00	AAA	-
23 三峡租赁 SCP003	2.64	270D	10.00	AAA	-
23 华发集团 SCP011	2.70	270D	10.00	AAA	-
23 洪市政 SCP004	2.43	270D	10.00	AAA	-
23 天津港 SCP003 (科创票据)	2.64	270D	10.00	AAA	-
23 赣州城投 SCP003	2.90	270D	10.00	AA+	-
23 曲文投 SCP003	6.30	270D	10.00	AA+	-
23 中兵投资 SCP003	2.69	270D	10.00	AA+	-
23 沈阳地铁 SCP002	2.95	270D	8.00	AAA	-
23 鹰潭国控 SCP002	3.33	270D	8.00	AA+	-
23 中林集团 SCP008	4.60	270D	7.80	AA+	-
23 杭金投 SCP010	2.56	270D	6.00	AAA	-
23 天津轨交 SCP015	3.18	270D	6.00	AAA	-

23 青岛海控 SCP004	2.98	270D	6.00	AAA	-
23 江西金融 SCP002	3.45	270D	6.00	AA+	-
23 园博园 SCP004	3.58	270D	5.90	AA	-
23 瀚瑞投资 SCP011	3.30	270D	5.30	AA+	-
23 柳钢集团 SCP004 (科创票据)	2.96	270D	5.00	AAA	-
23 南昌轨交 SCP004	2.54	270D	5.00	AAA	-
23 天津轨交 SCP014	2.91	270D	5.00	AAA	-
23 广东旅控 SCP002	2.59	270D	5.00	AA+	-
23 江宁科学 SCP002	2.82	270D	5.00	AA+	-
23 中原金控 SCP002	5.10	270D	5.00	AA+	-
23 镇海投资 SCP002	2.74	270D	5.00	AA+	-
23 即墨旅投 SCP003	3.38	270D	5.00	AA+	-
23 武商 SCP002	2.60	270D	5.00	AA+	-
23 伊犁财通 SCP003	2.92	270D	5.00	AA+	-
23 合肥高新 SCP002	2.80	270D	5.00	AA	-
23 天津轨交 SCP016	3.10	270D	4.00	AAA	-
23 东阳光 SCP007	6.80	270D	4.00	AA+	-
23 共享工业 SCP005	3.65	270D	4.00	AA	-
23 宿迁新城 SCP003	3.19	270D	3.90	AA	-
23 吴中经发 SCP016	2.70	270D	3.00	AA+	-
23 华媒 SCP002	2.87	270D	2.60	AA+	-
23 新运城发 SCP001	2.95	270D	2.53	AA+	-
23 红豆 SCP004 (科创票据)	7.60	270D	2.00	AA+	-
23 高淳国资 SCP006	2.90	270D	2.00	AA+	-
23 靖江港 SCP005	3.43	270D	1.00	AA+	-
23 经开国发 SCP010	2.69	270D	1.00	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 昆明安居 CP001	7.80	300D	5.44	AA+	A-1
23 安吉租赁 CP002	2.71	365D	5.00	AA+	-
23 花园 CP002	5.00	365D	5.00	AA+	-
23 渝惠通 CP002	3.17	365D	5.00	AA+	-
23 上饶城投 CP002	3.43	366D	12.00	AA+	-
23 鲁宏桥 CP006	4.21	366D	10.00	AA+	A-1
23 宁波经开 CP001	2.68	366D	10.00	AA+	-
23 泰安城投 CP001	3.10	366D	10.00	AA+	-
23 榆林能源 CP004	2.75	366D	6.00	AA+	-
23 涪陵交通 CP001	3.50	366D	5.30	AA	-
23 青岛海控 CP002	2.97	366D	5.00	AAA	-
23 江阴临港 CP001	2.99	366D	5.00	AA+	-
23 青岛华通 CP002	2.95	366D	5.00	AA+	-
23 百业源 CP002	2.79	366D	5.00	AA+	-
23 长寿开投 CP001	4.00	366D	5.00	AA+	A-1
23 高淳建设 CP007	2.98	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 宿迁城投 CP002	2.71	366D	3.00	AA+	-
23 津城建 MTN005	4.30	1.23	10.00	AAA	-
23 一汽租赁 MTN001	2.79	1.33	10.00	AAA	-
23 豫航空港 MTN014	4.39	1.48	15.00	AAA	-
23 津城建 MTN003	4.70	1.49	20.00	AAA	-
23 豫航空港 MTN013	4.23	1.50	15.00	AAA	-
23 福瑞能源 MTN002(能源保供特别债)	3.11	2.00	35.00	AAA	AAA
23 华能 MTN015	3.08	2.00	20.00	AAA	AAA
23 陕西交通 MTN003	3.12	2.00	15.00	AAA	AAA
23 金隅 MTN004	3.50	2.00	15.00	AAA	AAA
23 鲁钢铁 MTN005	4.60	2.00	15.00	AAA	AAA
23 华能新能 MTN005	3.10	2.00	15.00	AAA	AAA
23 津城建 MTN004	5.62	2.00	10.00	AAA	AAA
23 光大绿环 GN002 (乡村振兴)	2.83	2.00	10.00	AAA	AAA
23 闽冶金 MTN003	3.30	2.00	10.00	AAA	AAA
23 京能国际 MTN001	3.68	2.00	10.00	AAA	AAA
23 深圳地铁 MTN003A	2.78	2.00	10.00	AAA	AAA
23 淄博城运 MTN004A	3.20	2.00	10.00	AAA	AAA
23 淄博城运 MTN004B	3.95	2.00	10.00	AAA	AAA
23 中交投 MTN003A	3.18	2.00	6.00	AAA	AAA
23 新疆发电 MTN001 (绿色)	3.83	2.00	5.00	AA+	AA+
23 大榭开发 MTN002	3.23	2.00	4.00	AA	-
23 水电一局 MTN001	3.80	2.00	3.00	AA+	AA+
23 镇国投 MTN004	3.40	2.00	3.00	AA+	-
23 哈密国投 MTN001	4.08	2.00	3.00	AA	-
23 中交一公 MTN001 (绿色)	3.14	2.00	2.00	AAA	AAA
23 晋能煤业 MTN006	3.45	3.00	30.00	AAA	-
23 晋焦煤 MTN002	3.40	3.00	30.00	AAA	AAA
23 鲁高速 MTN008	3.07	3.00	20.00	AAA	AAA
23 首都机场 MTN001 (绿色)	2.73	3.00	20.00	AAA	-
23 成交投 MTN001	3.49	3.00	15.00	AAA	AAA
23 中建三局 MTN001 (科创票据)	3.45	3.00	15.00	AAA	-
23 江北新区 MTN011	4.10	3.00	12.00	AAA	AAA
23 临空港投 MTN001	3.60	3.00	11.70	AA+	-
23 华发实业 MTN003B	3.62	3.00	11.00	AAA	AAA
23 乌城投 MTN001	3.24	3.00	10.00	AAA	-
23 济南轨交 MTN002A	3.68	3.00	10.00	AAA	-
23 中建六局 MTN001 (科创票据)	3.70	3.00	10.00	AAA	AAA
23 宿迁产业 MTN001	3.20	3.00	10.00	AAA	-
23 河钢集 MTN013	4.04	3.00	10.00	AAA	AAA
23 津渤海 MTN004	7.50	3.00	10.00	AAA	-
23 绍兴高新 MTN001	3.49	3.00	10.00	AA+	-

23 晋江国资 MTN003	3.51	3.00	10.00	AA+	-
23 中交天航 MTN001 (科创票据)	3.79	3.00	10.00	AA+	AA+
23 晋路桥 MTN002 (科创票据)	4.00	3.00	10.00	AA+	-
23 通顺交投 MTN002	3.70	3.00	7.40	AA+	-
23 越秀租赁 MTN003	3.33	3.00	7.00	AAA	-
23 惠山国投 MTN002	3.32	3.00	7.00	AA+	-
23 驻马店投 MTN002	4.87	3.00	7.00	AA+	-
23 泰兴城投 MTN003	3.99	3.00	6.00	AA+	-
23 柯桥开发 MTN003	3.35	3.00	6.00	AA+	-
23 大兴发展 MTN001	2.90	3.00	5.70	AAA	-
23 嘉秀发展 MTN001	3.46	3.00	5.20	AA+	-
23 中交一公 MTN002	3.33	3.00	5.00	AAA	AAA
23 冀建投 MTN001A	3.07	3.00	5.00	AAA	AAA
23 凤凰传媒 MTN002	3.07	3.00	5.00	AAA	-
23 龙岩汇金 MTN002	3.28	3.00	5.00	AA+	-
23 金坛国发 MTN002	3.78	3.00	5.00	AA+	-
23 光明房产 MTN004	3.20	3.00	5.00	AA+	-
23 凤城河 MTN003	3.82	3.00	5.00	AA+	-
23 江阴临港 MTN001	3.76	3.00	5.00	AA+	-
23 苏科技城 MTN007	3.40	3.00	5.00	AA	-
23 中交投 MTN003B	3.43	3.00	4.00	AAA	AAA
23 张家国资 MTN004	3.10	3.00	4.00	AAA	-
23 商丘发展 MTN002	4.27	3.00	4.00	AA+	-
23 信阳建投 MTN006	5.20	3.00	4.00	AA+	-
23 溧水产投 MTN002	3.95	3.00	4.00	AA	-
23 东龙控股 MTN002	3.60	3.00	3.00	AA+	-
23 广州地铁 MTN008	3.04	5.00	25.00	AAA	AAA
23 深投控 MTN003	3.10	5.00	15.00	AAA	-
23 北控水务 MTN001	3.35	5.00	10.00	AAA	-
23 长春城投 MTN003	5.50	5.00	10.00	AAA	-
23 济南轨交 MTN002B	4.27	5.00	10.00	AAA	-
23 汉江国资 MTN006	3.75	5.00	10.00	AAA	-
23 迈瑞城投 MTN001	3.98	5.00	10.00	AA+	-
23 华发实业 MTN003A	4.15	5.00	9.00	AAA	AAA
23 望城经开 MTN002	3.55	5.00	7.00	AA+	-
23 粤交投 MTN005	3.65	5.00	6.60	AAA	AAA
23 望城城投 MTN001	3.45	5.00	6.00	AA+	-
23 浙商资产 MTN006	3.34	5.00	5.00	AAA	-
23 陕西金融 MTN003	3.60	5.00	5.00	AAA	AAA
23 深圳地铁 MTN003B	3.27	10.00	15.00	AAA	AAA
23 冀建投 MTN001B	3.55	10.00	5.00	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 1BP，上周收于 2.40%；6 个月品种收益率较前周上行 10BP，上周收于 2.56%；1 年期品种收益率较前周上行 6BP，上周收于 2.67%。
- 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 1BP，上周收于 3.14%；5 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 3.35%。
- 企业债方面，收益率小幅震荡。AAA 级企业债中，3 年期品种收益率较前周下行 1BP，上周收于 2.86%；5 年期品种收益率较前周上行 1BP，上周收于 3.10%；10 年期品种收益率较前周上行 1BP，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10.1BP，上周收于4.434%。
- 德国国债价格下跌，10年期德国国债收益率较前周上行6.4BP，上周收于2.739%。

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	5.110	7.7	24.7	68.4
5年	4.558	9.5	30.4	55.5
10年	4.434	10.1	32.6	55.9
30年	4.525	10.7	31.4	56.2
德国国债				
2年	3.258	4.3	28.0	49.4
5年	2.750	5.8	27.3	17.2
10年	2.739	6.4	27.3	16.8
30年	2.893	7.6	30.2	34.8

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 11.00BP，上周收于 4.1435%。

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	5.0103	7.38	24.34	56.43
10 年	4.1435	11.00	31.61	58.60
30 年	3.8445	11.18	30.35	63.60

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周上涨 0.07%，上周最高 1947.29 美元/盎司、最低 1912.70 美元/盎司，收于 1924.99 美元/盎司。
- 白银价格较前周上涨 2.27%，上周最高 23.77 美元/盎司、最低 22.80 美元/盎司，收于 23.53 美元/盎司。
- 铂金价格较前周上涨 0.14%，上周最高 949.89 美元/盎司、最低 911.33 美元/盎司，收于 926.32 美元/盎司。
- 钯金价格较前周上涨 0.05%，上周最高 1291.61 美元/盎司、最低 1222.57 美元/盎司，收于 1249.14 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	1924.99	0.07%	-0.76%
白银	23.53	2.27%	-3.70%
铂金	926.32	0.14%	-4.26%
钯金	1249.14	0.05%	2.84%

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 0.08%，上周最高 92.43 美元/桶、最低 88.37 美元/桶，收于 90.33 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周下跌 1.01%，上周最高 94.57 美元/桶、最低 91.12 美元/桶，收于 92.43 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	90.33	-0.08%	8.94%
ICE Brent 主力合约	92.43	-1.01%	7.20%

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 2.50%，上周最高 8352.00 美元/吨、最低 8198.50 美元/吨，收于 8198.50 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周上涨 2.50%，上周最高 2254.00 美元/吨、最低 2215.50 美元/吨，收于 2251.00 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	8198.50	-2.50%	-2.83%
LME 3 月铝	2251.00	2.50%	2.25%

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 3.23%，上周最高 1344.50 美分/蒲式耳、最低 1292.50 美分/蒲式耳，收于 1295.25 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)	579.50	-4.02%	-16.26%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1295.25	-3.23%	-5.28%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	477.75	0.53%	-6.73%
ICE 棉花(美分/磅)	85.94	-0.88%	-1.95%
ICE 白糖(美分/磅)	27.32	1.07%	7.39%

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 1.33%，上周最高 3.072 美元/百万英热单位、最低 2.832 美元/百万英热单位，收于 2.888 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	2.888	-1.33%	-7.79%

数据来源：路透