

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7.1793，较前周贬值约0.03%；银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.15%，上周收于7.3150；1年期掉期点较前周下行10个点，上周收于-2645。
 - ✓ 1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行52个点，上周收于7.1327。
- **外币汇率市场上周概览**
 - ✓ 美元指数较前周下跌0.45%，上周收于106.163。
 - ✓ 欧元兑美元较前周上涨0.80%，上周收于1.0593。
 - ✓ 美元兑日元较前周上涨0.19%，上周收于149.84。
 - ✓ 澳元兑美元较前周上涨0.33%，上周收于0.6312。
- **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1.91%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2.10%和2.80%。
 - ✓ 二级市场：10年期国债收益率较前周上行2BP，上周收于2.73%；5年期国开债收益率较前周上行7BP，上周收于2.65%。
 - ✓ 一级市场：财政部招标发行91天和182天期贴现国债，以及2年和7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年和10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97支，规模合计935.84亿元；短期融资券15支，规模合计125.00亿元；中期票据98支，规模合计890.34亿元。
 - ✓ 二级市场：短期融资券收益率区间震荡，中期票据、企业债收益率均震荡上行。
- **外币利率市场上周概览**
 - ✓ 美国国债价格整体下跌，10年期美国国债收益率较前周上行30.1BP，上周收于4.914%。
 - ✓ 德国国债价格区间震荡，10年期德国国债收益率较前周上行15.2BP，上周收于2.889%。
- **贵金属市场上周概览**
 - ✓ 黄金价格较前周上涨2.55%，上周收于1981.04美元/盎司。
 - ✓ 白银价格较前周上涨2.86%，上周收于23.35美元/盎司。
 - ✓ 铂金价格较前周上涨1.56%，上周收于894.75美元/盎司。
 - ✓ 钯金价格较前周下跌4.36%，上周收于1097.88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2.23%，上周收于88.30美元/桶。
 - ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周上涨1.88%，上周收于92.51美元/桶。
- **基本金属市场上周概览**
 - ✓ LME3月期铜价格较前周下跌0.11%，上周收于7940.00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1.40%，上周收于1319.75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8.32%，上周收于3.260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20日）报 7.1793，较前周贬值约 0.03%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.15%，上周最高 7.2905、最低 7.3194，收于 7.3150，波幅为 0.40%。
- 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 10 个点，上周最高-2610、最低-2659，收于-2645，波幅为 1.85%。
- 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 52 个点，上周最高 7.1650、最低 7.1074，17:00 收于 7.1327，波幅为 0.71%。

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	-	-	7.1793	18	-5	2147
银行间市场汇价	7.3194	7.2905	7.3150	110	148	3636
掉期点						
1 个月期限	-197	-226	-202	10	7	-43
2 个月期限	-407	-423	-418	15	15	-89
3 个月期限	-616	-654	-625	22	26	-118
6 个月期限	-1260	-1313	-1290	11	30	-250
1 年期限	-2610	-2659	-2645	-10	80	-665

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	7.2428	7.1940	7.2109	58	2789	-839
2 个月期限	7.2594	7.2095	7.2286	91	3106	-446
3 个月期限	7.2660	7.2145	7.2373	128	3333	-153
6 个月期限	7.2485	7.1925	7.2182	209	3550	322
1 年期限	7.1650	7.1074	7.1327	52	3397	822

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 0.45%，上周最高 106.670、最低 105.975，收于 106.163。
- 欧元兑美元较前周上涨 0.80%，上周最高 1.0616、最低 1.0505，收于 1.0593。
- 美元兑日元较前周上涨 0.19%，上周最高 150.03、最低 149.21，收于 149.84。
- 澳元兑美元较前周上涨 0.33%，上周最高 0.6393、最低 0.6288，收于 0.6312。

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	106.163	-0.45%	-0.06%
欧元/美元	1.0593	0.80%	0.22%
美元/日元	149.84	0.19%	0.33%
澳元/美元	0.6312	0.33%	-1.90%

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 1.91%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 2.10%和 2.80%。央行公开市场方面，上周一（10 月 16 日）进行逆回购操作 2150 亿元和中期借贷便利（MLF）操作 7890 亿元，逆回购到期 2400 亿元；上周二（10 月 17 日）进行逆回购操作 710 亿元，逆回购到期 670 亿元和 MLF 到期 5000 亿元；上周三（10 月 18 日）进行逆回购操作 1050 亿元，逆回购到期 1020 亿元；上周四（10 月 19 日）进行逆回购操作 3440 亿元，逆回购到期 1620 亿元；上周五进行逆回购操作 8280 亿元，逆回购到期 950 亿元。本周（10 月 23 日-10 月 27 日）将有逆回购到期 14540 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)	1.91	17	-25
7 天 Shibor (1W)	2.10	21	-9
3 月期 Shibor (3M)	2.34	3	4
隔夜回购定盘利率 (FR001)	2.00	17	-20
7 天回购定盘利率 (FR007)	2.80	75	60

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，收益率整体上行。1年期国债收益率较前周上行13BP，上周收于2.31%；5年期国债收益率较前周上行7BP，上周收于2.58%；10年期国债收益率较前周上行2BP，上周收于2.73%。
- 政策性金融债方面，收益率整体上行。1年期国开债收益率较前周上行15BP，上周收于2.45%；5年期国开债收益率较前周上行7BP，上周收于2.65%；10年期国开债收益率较前周上行3BP，上周收于2.89%。

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	2.31	13	14
3年期	2.42	5	4
5年期	2.58	7	11
7年期	2.66	4	6
10年期	2.73	2	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	2.45	15	20
3年期	2.50	12	16
5年期	2.65	7	9
7年期	2.79	6	6
10年期	2.89	3	3

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 2 年和 7 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。
- 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 1 年、3 年和 10 年期固息债；进出口行招标发行 2 年、3 年、5 年和 10 年期固息债。上周五进出口行招标发行 1 年期固息债；农发行招标发行 2 年和 3 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，收益率整体上行。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 15BP；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 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	2.25	15	24
6 月期	2.19	11	17
9 月期	2.16	10	13
1 年期	2.14	8	10
3 年期	2.32	6	7
4 年期	2.43	5	7
5 年期	2.53	5	6
7 年期	2.64	2	7
10 年期	2.79	4	10
3 月 Shibor (ACT/360)			
6 月期	2.40	10	8
9 月期	2.40	10	11
1 年期	2.39	9	12
2 年期	2.48	9	12
3 年期	2.58	7	10
4 年期	2.71	7	10
5 年期	2.82	7	7
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 97 支，规模合计 935.84 亿元；短期融资券 15 支，规模合计 125.00 亿元；中期票据 98 支，规模合计 890.34 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限震荡，区间为-2BP 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 沪电力 SCP020	2.16	30D	25.00	AAA	-
23 一汽租赁 SCP008	2.38	32D	10.00	AAA	-
23 中建八局 SCP013	2.11	34D	50.00	AAA	-
23 中建三局 SCP009 (科创票据)	2.14	35D	20.00	AAA	-
23 华能 SCP018	2.01	43D	15.00	AAA	-
23 新华报业 SCP008	2.33	51D	5.00	AA+	-
23 中国有色 SCP001	2.35	56D	10.00	AAA	-
23 电建租赁 SCP002	2.50	58D	5.00	AA+	-
23 国网租赁 SCP007	2.18	59D	10.00	AAA	-
23 东方电气 SCP003 (科创票据)	2.09	60D	30.00	AAA	-
23 中交三航 SCP005 (科创票据)	2.16	60D	10.00	AAA	-
23 中航租赁 SCP005	2.25	60D	5.00	AAA	-
23 苏州高技 SCP011	2.41	62D	4.00	AAA	-
23 伊利实业 SCP023	2.20	72D	65.00	AAA	-
23 伊利实业 SCP022	2.23	72D	45.00	AAA	-
23 国盛 SCP009	2.26	88D	10.00	AAA	-
23 苏交通 SCP022	2.28	90D	20.00	AAA	-
23 苏盐业 SCP001	2.35	90D	3.00	AA+	-
23 宁沪高 SCP021	2.30	93D	5.40	AAA	-
23 宁沪高 SCP023	2.30	93D	5.00	AAA	-
23 宁沪高 SCP022	2.30	93D	5.00	AAA	-
23 徐工集团 SCP018	2.32	93D	5.00	AAA	-
23 中拓 SCP009	2.68	95D	5.00	AA+	-
23 济南城建 SCP012	2.40	99D	10.00	AAA	-
23 江宁城建 SCP007	2.50	100D	5.00	AAA	-
23 中国信科 SCP005	2.51	108D	15.00	AAA	-
23 云南机场 SCP003	2.80	150D	5.00	AAA	-
23 华电资本 SCP006	2.52	150D	3.00	AAA	-
23 碧水源 SCP006 (科创票据)	3.34	150D	5.00	AA+	-
23 云建投 SCP024	3.80	151D	10.00	AAA	-

23 浙交投 SCP019	2.32	153D	10.00	AAA	-
23 浙交投 SCP018	2.36	153D	10.00	AAA	-
23 中集租赁 SCP003	3.00	156D	5.00	AA+	-
23 宁波国贸 SCP002	2.70	163D	2.00	AA	-
23 苏州港 SCP004	2.58	168D	3.00	AA+	-
23 京电子城 SCP004	3.38	171D	5.00	AA	-
23 豫园商城 SCP003	5.50	175D	3.00	AAA	-
23 深能源 SCP005	2.41	180D	30.00	AAA	-
23 光大集团 SCP014	2.36	180D	30.00	AAA	-
23 鲁高速 SCP005	2.42	180D	20.00	AAA	-
23 沪国资 SCP003	2.43	180D	10.00	AAA	-
23 国投交控 SCP002	2.54	180D	5.00	AAA	-
23 天成租赁 SCP018	2.64	180D	5.00	AAA	-
23 陕西金控 SCP003	2.60	180D	5.00	AAA	-
23 扬子国资 SCP004	2.36	180D	5.00	AAA	-
23 威高 SCP003(科创票据)	4.44	180D	7.00	AA+	-
23 南京高科 SCP010	2.90	180D	5.00	AA+	-
23 钟山资产 CP005	2.69	180D	3.50	AA+	-
23 申通快递 SCP001	2.50	180D	2.00	AA+	-
23 钟山资产 SCP004	2.73	180D	1.30	AA+	-
23 中盐 SCP004	2.51	183D	5.00	AAA	-
23 金华轨交 SCP004	2.50	183D	2.45	AA+	-
23 金华轨交 SCP003	2.50	184D	3.50	AA+	-
23 津渤海 SCP016	5.50	210D	10.00	AAA	-
23 越秀租赁 SCP010	2.65	221D	6.00	AAA	-
23 象屿 SCP008	2.73	240D	20.00	AAA	-
23 桂铁投 SCP002	3.07	240D	12.40	AAA	-
23 津渤海 SCP015	5.50	240D	10.00	AAA	-
23 青岛北发 SCP003	2.98	240D	6.00	AA+	-
23 吴中国太 SCP006	2.75	240D	2.00	AA+	-
23 武金控 SCP004	3.00	256D	5.00	AAA	-
23 华数 SCP007	2.48	265D	5.00	AAA	-
23 厦门市政 SCP003	2.46	267D	8.00	AAA	-
23 南航集 SCP007	2.45	268D	14.00	AAA	-
23 临港控股 SCP006	2.53	268D	10.00	AAA	-
23 杭金投 SCP012	2.59	268D	6.00	AAA	-
23 滨建投 SCP033	3.40	268D	8.00	AAA	-
23 三明投资 SCP002	2.70	268D	3.50	AA	-
23 淮安开发 SCP004	3.00	269D	1.20	AA+	-
23 国新租赁 SCP007	2.53	270D	20.00	AAA	-
23 物产中大 SCP007	2.52	270D	20.00	AAA	-
23 鲁钢铁 SCP010	2.85	270D	15.00	AAA	-

23 桂交投 SCP004	2.69	270D	15.00	AAA	-
23 津保投 SCP020	3.24	270D	10.00	AAA	-
23 华发集团 SCP012	2.63	270D	10.00	AAA	-
23 柳钢集团 SCP005(科创票据)	2.96	270D	5.00	AAA	-
23 滨建投 SCP034	3.45	270D	10.00	AAA	-
23 越秀交通 SCP004	2.51	270D	5.00	AAA	-
23 天津轨交 SCP018	2.98	270D	5.00	AAA	-
23 东莞交投 SCP002	2.42	270D	5.00	AAA	-
23 黄山旅游 SCP002	2.74	270D	5.00	AAA	-
23 福州新发 SCP003	2.80	270D	3.30	AAA	-
23 昆明新都 CP001	8.00	270D	13.79	AA+	-
23 安吉租赁 SCP001	2.87	270D	6.00	AA+	-
23 鲁商 SCP016	5.57	270D	5.00	AA+	-
23 海安开投 SCP004	3.00	270D	5.00	AA+	-
23 盐城国投 SCP002	3.10	270D	5.00	AA+	-
23 宁夏农垦 SCP008(乡村振兴)	3.39	270D	5.00	AA+	-
23 乌交旅 SCP001	2.99	270D	5.00	AA+	-
23 宜昌高新 SCP002	3.00	270D	5.00	AA+	-
23 长沙水业 SCP004	2.79	270D	3.00	AA+	-
23 南京高科 SCP011	3.01	270D	2.50	AA+	-
23 杭州日报 SCP002	2.99	270D	2.00	AA+	-
23 武清经开 SCP008	4.00	270D	10.00	AA	-
23 南太湖 SCP001	3.00	270D	7.00	AA	-
23 连云工投 SCP003	3.50	270D	5.00	AA	-
23 随州城投 SCP006	3.30	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	债券评级
23 云投 CP001	5.10	360D	15.00	AAA	-
23 云能投 CP013	3.38	365D	20.00	AAA	-
23 水发集团 CP001	4.80	365D	10.00	AAA	-
23 津城建 CP020	3.68	366D	15.00	AAA	-
23 红狮 CP001	2.90	366D	10.00	AAA	-
23 陕西金融 CP001	2.88	366D	4.00	AAA	-
23 黄石城发 CP005	3.50	366D	10.00	AA+	-
23 三门峡 CP004	3.15	366D	7.00	AA+	-
23 徐州交通 CP003	2.78	366D	7.00	AA+	-
23 长寿开投 CP004	3.40	366D	5.00	AA+	-
23 万州经开 CP002	3.43	366D	5.00	AA+	-
23 中兴国资 CP003	2.99	366D	5.00	AA+	-
23 哈城投 CP002	3.20	366D	3.00	AA+	-
23 景德城投 CP005	4.50	366D	7.00	AA	-
23 新盛投资 CP003	3.15	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	债券评级
23 南京高科 MTN002	2.95	1.01	3.50	AA+	-
23 津城建 MTN007	3.99	1.37	12.00	AAA	-
23 一汽租赁 MTN003	2.81	1.40	15.00	AAA	-
23 山西建投 MTN006	5.38	2.00	20.00	AAA	-
23 大唐发电 MTN010	3.09	2.00	20.00	AAA	AAA
23 中化股 MTN003	3.14	2.00	20.00	AAA	-
23 中电投 MTN043	2.66	2.00	17.00	AAA	-
23 中电投 MTN042	2.66	2.00	16.00	AAA	-
23 陕西交通 MTN004	3.25	2.00	15.00	AAA	AAA
23 北部湾 MTN005	3.75	2.00	10.00	AAA	-
23 晋能装备 MTN005	3.77	2.00	10.00	AAA	AAA
23 鲁钢铁 MTN007	4.80	2.00	10.00	AAA	AAA
23 中电投 MTN044A	3.19	2.00	12.00	AAA	AAA
23 京住总集 MTN002	3.40	2.00	7.00	AAA	-
23 陕有色 MTN002	3.55	2.00	5.00	AAA	AAA
23 大唐陕西 MTN004	3.53	2.00	5.00	AAA	-
23 龙城发展 MTN004	3.47	2.00	5.00	AAA	-
23 六合国资 MTN003	3.28	2.00	6.80	AA+	-
23 潍坊投资 MTN002	4.50	2.00	6.00	AA+	-
23 天津经开 MTN001	3.65	2.00	10.00	AA+	AA+
23 现代投资 MTN001	3.59	2.00	5.00	AA+	-
23 衡阳城投 MTN005	4.00	2.00	4.00	AA+	-
23 水利四 MTN001	3.56	2.00	3.00	AA+	AA+
23 苏科技城 MTN008	3.83	2.00	1.00	AA	-
23 嘉定工业 MTN001	3.05	2.49	4.00	AA+	-
23 南航股 MTN001	2.98	3.00	20.00	AAA	-
23 青岛地铁 MTN003	3.27	3.00	20.00	AAA	-
23 大唐集 MTN017	3.40	3.00	20.00	AAA	AAA
23 中金集 MTN004(科创票据)	3.44	3.00	20.00	AAA	-
23 沪电力 MTN001	3.29	3.00	20.00	AAA	AAA
23 华能水电 GN017(科创票据)	3.35	3.00	20.00	AAA	-
23 沪电力 MTN002	3.28	3.00	18.00	AAA	AAA
23 北排水 MTN001	2.99	3.00	15.00	AAA	AAA
23 中建三局 MTN002	3.40	3.00	15.00	AAA	-
23 广州地铁 MTN009(绿色)	2.83	3.00	13.00	AAA	AAA
23 金融资本 MTN002	3.15	3.00	13.00	AAA	AAA
23 成都产投 MTN004(科创票据)	3.20	3.00	13.00	AAA	-
23 成都天府 MTN001	3.20	3.00	10.00	AAA	-
23 桂交投 MTN004	3.80	3.00	10.00	AAA	-
23 江北新区 MTN009	3.95	3.00	10.00	AAA	AAA

23 临港经济 MTN002	3.50	3.00	10.00	AAA	AAA
23 华阳新材 MTN014	3.35	3.00	10.00	AAA	-
23 国网海投 MTN001BC	2.87	3.00	10.00	AAA	AAA
23 济南城建 MTN004A	3.28	3.00	5.00	AAA	-
23 沪国资 MTN002	2.87	3.00	10.00	AAA	-
23 中电投 MTN044B	3.37	3.00	6.00	AAA	AAA
23 国联 MTN009	3.08	3.00	8.00	AAA	-
23 徐州产城 MTN003	3.32	3.00	7.15	AAA	-
23 招商蛇口 MTN003	3.10	3.00	7.00	AAA	-
23 鄂文旅 MTN003	3.40	3.00	7.00	AAA	-
23 中国航材 MTN001	3.25	3.00	6.00	AAA	AAA
23 张家国资 MTN006	3.12	3.00	6.00	AAA	AAA
23 通商租赁 MTN002	3.15	3.00	5.00	AAA	-
23 通威 GN001(科创票据)	3.10	3.00	5.00	AAA	-
23 苏州交投 MTN001(乡村振兴)	2.99	3.00	5.00	AAA	-
23 乌城投 MTN002A	3.30	3.00	7.00	AAA	-
23 保利置业 MTN003	3.48	3.00	5.00	AAA	-
23 冀中能源 MTN007(科创票据)	5.40	3.00	5.00	AAA	-
23 招商蛇口 GN002	2.90	3.00	4.00	AAA	-
23 锡交通 MTN001(混合型科创票 据)	2.95	3.00	0.80	AAA	-
23 淮安交通 MTN001	3.93	3.00	10.00	AA+	-
23 舟山海洋 MTN001	3.65	3.00	10.00	AA+	-
23 湘建工 MTN002(科创票据)	3.75	3.00	10.00	AA+	-
23 常德城投 MTN003	3.75	3.00	8.00	AA+	-
23 怀柔国资 MTN001	3.10	3.00	7.80	AA+	AA+
23 长交集团 MTN001	3.05	3.00	5.00	AA+	-
23 武侯资本 MTN002	3.97	3.00	5.00	AA+	AA+
23 驻马店投 MTN003	4.57	3.00	5.00	AA+	-
23 浦口康居 MTN001	3.50	3.00	5.00	AA+	-
23 柳州东投 MTN002	7.80	3.00	4.50	AA+	-
23 嘉兴产业 MTN002	3.57	3.00	4.00	AA+	-
23 洛阳城投 MTN001	3.21	3.00	4.00	AA+	-
23 新业国资 MTN001	4.00	3.00	5.00	AA+	-
23 南宁高新 MTN002	4.80	3.00	4.50	AA	-
23 澳柯玛集 MTN001	4.90	3.00	3.00	AA	-
23 青岛国信 MTN007A	3.42	4.00	7.00	AAA	-
23 国贸房产 MTN003(绿色)	3.94	4.00	3.00	AA	AAA
23 鲁信 MTN004	3.49	5.00	15.00	AAA	-
23 粤海 MTN002	2.79	5.00	15.00	AAA	-
23 汉江国资 MTN007	3.80	5.00	10.00	AAA	-
23 重庆发展 MTN002	3.37	5.00	15.00	AAA	AAA

23 杭城投 MTN001	3.18	5.00	10.00	AAA	-
23 北控水务 MTN002	3.30	5.00	10.00	AAA	AAA
23 中国燃气 MTN002	3.20	5.00	15.00	AAA	-
23 临港控股 MTN001	3.17	5.00	10.00	AAA	AAA
23 济南城建 MTN004B	3.48	5.00	15.00	AAA	-
23 苏州高技 MTN004	3.40	5.00	5.00	AAA	-
23 绍兴交投 MTN002	3.05	5.00	5.00	AAA	-
23 青岛国信 MTN007B	3.63	5.00	3.00	AAA	-
23 乌城投 MTN002B	3.65	5.00	3.00	AAA	-
23 抚州投资 MTN001	3.92	5.00	12.00	AA+	-
23 椒江国资 MTN001	3.53	5.00	7.00	AA+	-
23 海宁资产 MTN002	3.60	5.00	5.70	AA+	-
23 海鸿投资 MTN001	3.30	5.00	5.00	AA+	-
23 十堰城发 MTN003	3.76	5.00	5.00	AA+	-
23 成都经开 MTN002	3.95	5.00	5.00	AA+	-
23 钦州开投 MTN001	6.50	5.00	5.79	AA	-
23 遂宁开达 MTN001	5.50	5.00	4.80	AA	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 2.39%；6 个月品种收益率较前周上行 2BP，上周收于 2.57%；1 年期品种收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.68%。
- 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 7BP，上周收于 3.17%；5 年期品种收益率较前周上行 6BP，上周收于 3.40%。
- 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 7BP，上周收于 2.99%；5 年期品种收益率与前周基本持平，上周收于 3.13%；10 年期品种收益率较前周上行 3BP，上周收于 3.34%。

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格整体下跌，10年期美国国债收益率较前周上行30.1BP，上周收于4.914%。
- 德国国债价格区间震荡，10年期德国国债收益率较前周上行15.2BP，上周收于2.889%。

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	5.073	1.9	2.9	64.7
5年	4.858	21.9	24.9	85.4
10年	4.914	30.1	34.3	103.9
30年	5.076	32.2	37.7	111.3
德国国债				
2年	3.122	-1.7	-8.1	35.8
5年	2.783	10.4	0.6	20.5
10年	2.889	15.2	5.0	31.8
30年	3.094	16.1	5.9	54.9

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 27.27BP，上周收于 4.5747%。

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	4.9522	1.02	-1.68	50.62
10 年	4.5747	27.27	30.97	101.72
30 年	4.3651	31.13	35.91	115.66

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周上涨 2.55%，上周最高 1997.09 美元/盎司、最低 1906.90 美元/盎司，收于 1981.04 美元/盎司。
- 白银价格较前周上涨 2.86%，上周最高 23.70 美元/盎司、最低 22.35 美元/盎司，收于 23.35 美元/盎司。
- 铂金价格较前周上涨 1.56%，上周最高 907.12 美元/盎司、最低 872.83 美元/盎司，收于 894.75 美元/盎司。
- 钯金价格较前周下跌 4.36%，上周最高 1156.60 美元/盎司、最低 1094.62 美元/盎司，收于 1097.88 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	1981.04	2.55%	7.18%
白银	23.35	2.86%	5.37%
铂金	894.75	1.56%	-1.07%
钯金	1097.88	-4.36%	-11.87%

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 2.23%，上周最高 89.85 美元/桶、最低 84.39 美元/桶，收于 88.30 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 1.88%，上周最高 93.79 美元/桶、最低 88.88 美元/桶，收于 92.51 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	88.30	2.23%	-0.57%
ICE Brent 主力合约	92.51	1.88%	0.43%

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 0.11%，上周最高 8010.50 美元/吨、最低 7940.00 美元/吨，收于 7940.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周下跌 0.89%，上周最高 2190.50 美元/吨、最低 2177.00 美元/吨，收于 2180.00 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	7940.00	-0.11%	-4.05%
LME 3 月铝	2180.00	-0.89%	-7.21%

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 1.40%，上周最高 1334.00 美分/蒲式耳、最低 1298.75 美分/蒲式耳，收于 1319.75 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

品种	收盘价	较前周 (%)	较上月末 (%)
CBOT 小麦(美分/蒲式耳)	584.25	0.78%	8.09%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1319.75	1.40%	1.91%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	495.50	0.30%	4.10%
ICE 棉花(美分/磅)	82.44	-4.31%	-5.45%
ICE 白糖(美分/磅)	26.85	-0.85%	1.28%

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 8.32%，上周最高 3.542 美元/百万英热单位、最低 3.247 美元/百万英热单位，收于 3.260 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	3.260	-8.32%	-1.39%

数据来源：路透