

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7.1151，较前周升值约0.81%；银行间市场人民币汇率较前周升值约1.31%，上周收于7.1529；1年期掉期点较前周下行30个点，上周收于-2585。
 - ✓ 1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周下行925个点，上周收于6.9635。
- **外币汇率市场上周概览**
 - ✓ 美元指数较前周下跌0.49%，上周收于103.403。
 - ✓ 欧元兑美元较前周上涨0.29%，上周收于1.0939。
 - ✓ 美元兑日元较前周下跌0.12%，上周收于149.44。
 - ✓ 澳元兑美元较前周上涨1.14%，上周收于0.6582。
- **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1.84%和1.93%，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2.20%和2.96%。
 - ✓ 二级市场：10年期国债收益率较前周上行5BP，上周收于2.71%；5年期国开债收益率较前周上行10BP，上周收于2.65%。
 - ✓ 一级市场：财政部招标发行91天期贴现国债，以及1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、7年和10年期固息债；进出口行招标发行1年、5年和7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99支，规模合计1042.70亿元；短期融资券8支，规模合计62.00亿元；中期票据71支，规模合计878.90亿元。
 - ✓ 二级市场：短期融资券收益率有所上行、中期票据和企业债收益率均小幅震荡。
- **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3.1BP，上周收于4.467%。
 - ✓ 德国国债价格下跌，10年期德国国债收益率较前周上行5.5BP，上周收于2.643%。
- **贵金属市场上周概览**
 - ✓ 黄金价格较前周上涨1.11%，上周收于2001.97美元/盎司。
 - ✓ 白银价格较前周上涨2.40%，上周收于24.30美元/盎司。
 - ✓ 铂金价格较前周上涨3.52%，上周收于930.61美元/盎司。
 - ✓ 钯金价格较前周上涨1.51%，上周收于1068.83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1.18%，上周收于75.18美元/桶。
 - ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周下跌0.34%，上周收于80.15美元/桶。
- **基本金属市场上周概览**
 - ✓ LME3月期铜价格较前周上涨1.58%，上周收于8440.00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1.02%，上周收于1330.25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4.28%，上周收于2.996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（11月24日）报 7.1151，较前周升值约 0.81%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 1.31%，上周最高 7.1256、最低 7.2075，收于 7.1529，波幅为 1.14%。
- 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 30 个点，上周最高-2502、最低-2598，收于-2585，波幅为 3.71%。
- 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）较前周下行 925 个点，上周最高 7.0546、最低 6.9257，收于 6.9635，波幅为 1.85%。

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	—	—	7.1151	-577	-628	1505
银行间市场汇价	7.2075	7.1256	7.1529	-936	-1647	2015
掉期点						
1 个月期限	-203	-228	-209	-1	9	-50
2 个月期限	-426	-449	-443	-2	-15	-114
3 个月期限	-210	-679	-656	-1	-4	-149
6 个月期限	-1278	-1322	-1306	-11	38	-266
1 年期限	-2502	-2598	-2585	-30	100	-605

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	7.1675	7.0757	7.1035	-605	1715	-285
2 个月期限	7.1595	7.0568	7.0900	-660	1720	-186
3 个月期限	7.1500	7.0442	7.0770	-710	1730	-103
6 个月期限	7.1247	7.0052	7.0405	-825	1773	182
1 年期限	7.0546	6.9257	6.9635	-925	1705	691

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 0.49%，上周最高 104.213、最低 103.178，收于 103.403。
- 欧元兑美元较前周上涨 0.29%，上周最高 1.0964、最低 1.0850，收于 1.0939。
- 美元兑日元较前周下跌 0.12%，上周最高 149.99、最低 147.14，收于 149.44。
- 澳元兑美元较前周上涨 1.14%，上周最高 0.6590、最低 0.6498，收于 0.6582。

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	103.403	-0.49%	-3.06%
欧元/美元	1.0939	0.29%	3.43%
美元/日元	149.44	-0.12%	-1.47%
澳元/美元	0.6582	1.14%	3.88%

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 1.84%和 1.93%，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 2.20%和 2.96%。央行公开市场方面，上周一（11 月 20 日）进行逆回购操作 2050 亿元，逆回购到期 1130 亿元；上周二（11 月 21 日）进行逆回购操作 3190 亿元，逆回购到期 4240 亿元；上周三（11 月 22 日）进行逆回购操作 4600 亿元，逆回购到期 4950 亿元；上周四（11 月 23 日）进行逆回购操作 5190 亿元，逆回购到期 3770 亿元；上周五进行逆回购操作 6640 亿元，逆回购到期 3520 亿元。本周（11 月 27 日-12 月 1 日）将有逆回购到期 21670 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	-5	9
7 天 Shibor (1W)	2.20	23	23
3 月期 Shibor (3M)	2.46	0	5
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.93	-7	-37
7 天回购定盘利率 (FR007)	2.96	71	46

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，收益率有所上行。1 年期国债收益率较前周上行 21BP，上周收于 2.33%；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 5BP，上周收于 2.71%。
- 政策性金融债方面，收益率有所上行。1 年期国开债收益率较前周上行 10BP，上周收于 2.48%；5 年期国开债收益率较前周上行 10BP，上周收于 2.65%；10 年期国开债收益率较前周上行 5BP，上周收于 2.80%。

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	2.33	21	13
3 年期	2.48	10	7
5 年期	2.58	7	5
7 年期	2.71	6	2
10 年期	2.71	5	6

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	2.48	10	11
3 年期	2.59	9	7
5 年期	2.65	10	8
7 年期	2.83	4	3
10 年期	2.80	5	4

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 5 年期付息国债，上周五财政部招标发行 91 天期贴现国债和 10 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。上周二农发行招标发行 2 年和 7 年期固息债；国开行招标发行 1 年、3 年、5 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 7 年期固息债。上周五进出口行招标发行 1 年和 5 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，收益率有所上行。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 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 5BP 至 8BP；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	2.33	15	11
6 月期	2.23	11	11
9 月期	2.18	10	9
1 年期	2.16	10	8
3 年期	2.30	10	4
4 年期	2.40	10	4
5 年期	2.49	9	3
7 年期	2.60	9	3
10 年期	2.75	9	3
3 月 Shibor（ACT/360）			
6 月期	2.44	5	6
9 月期	2.41	7	5
1 年期	2.39	6	3
2 年期	2.46	7	4
3 年期	2.57	8	4
4 年期	2.67	7	2
5 年期	2.78	8	2
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 99 支，规模合计 1042.70 亿元；短期融资券 8 支，规模合计 62.00 亿元；中期票据 71 支，规模合计 878.90 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限区间波动-1BP 至 8BP。

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 东航股 SCP017	2.05	14D	20.00	AAA	-
23 东航股 SCP016	1.97	16D	20.00	AAA	-
23 杭实投 SCP004	2.25	29D	10.00	AAA	-
23 广州工控 SCP002	2.21	30D	12.00	AAA	-
23 中交二公 SCP003	2.13	31D	5.00	AAA	-
23 华能集 SCP018	1.97	32D	20.00	AAA	-
23 中冶 SCP007	2.15	35D	20.00	AAA	-
23 华能集 SCP019	2.06	35D	20.00	AAA	-
23 中冶 SCP006	2.12	36D	10.00	AAA	-
23 华能新能 SCP005	2.05	37D	20.00	AAA	-
23 苏国信 SCP015	2.08	38D	10.00	AAA	-
23 中建二局 SCP006	2.13	39D	30.00	AAA	-
23 皖能源 SCP002	2.19	41D	4.00	AAA	-
23 苏州港 SCP005	2.43	47D	5.00	AA+	-
23 华能江苏 SCP005 (科创票据)	2.25	49D	6.00	AAA	-
23 龙源电力 SCP015	2.32	57D	20.00	AAA	-
23 沪电力 SCP023	2.34	58D	10.00	AAA	-
23 中铝集 SCP005 (科创票据)	2.36	59D	20.00	AAA	-
23 中铝集 SCP006 (科创票据)	2.36	59D	10.00	AAA	-
23 广州工控 SCP003	2.54	60D	15.00	AAA	-
23 苏农垦 CP004	2.49	65D	5.00	AAA	-
23 江苏铁路 SCP007	2.34	70D	13.00	AAA	-
23 中电路桥 SCP012	2.42	75D	10.00	AAA	-
23 苏交通 SCP027	2.36	90D	10.00	AAA	-
23 滨湖建设 SCP012	2.51	90D	3.00	AA+	-
23 沪机场股 SCP006	2.38	94D	10.00	AAA	-
23 沪机场股 SCP005	2.38	95D	10.00	AAA	-
23 三一 SCP011 (科创票据)	2.58	97D	10.00	AAA	-
23 南通城建 SCP007	2.48	100D	10.00	AAA	-
23 苏州高新 SCP041	2.50	114D	3.00	AAA	-
23 苏州高新 SCP042	2.51	116D	2.00	AAA	-

23 招商局 SCP009	2.45	119D	60.00	AAA	—
23 兴业资产 SCP003	2.61	119D	10.00	AAA	—
23 华电资本 SCP007	2.46	120D	7.00	AAA	—
23 中电投 SCP013	2.36	129D	21.00	AAA	—
23 苏州高新 SCP043	2.56	140D	2.00	AAA	—
23 江西交投 SCP010	2.42	148D	20.00	AAA	—
23 盐城东方 SCP004	2.88	150D	6.00	AA+	—
23 静安投资 SCP003	2.49	154D	10.00	AA+	—
23 天成租赁 SCP020	2.61	175D	10.00	AAA	—
23 龙盛 SCP017（科创票据）	2.80	177D	4.50	AAA	—
23 金隅 SCP005	2.49	179D	20.00	AAA	—
23 广东建工 SCP002	2.59	179D	10.00	AAA	—
23 鲁高速 SCP007	2.57	180D	30.00	AAA	—
23 中兴通讯 SCP098	2.55	180D	15.00	AAA	—
23 中兴通讯 SCP096	2.55	180D	15.00	AAA	—
23 鲁钢铁 SCP015	2.87	180D	15.00	AAA	—
23 中兴通讯 SCP095	2.55	180D	10.00	AAA	—
23 中兴通讯 SCP097	2.55	180D	10.00	AAA	—
23 陕建集团 SCP010（科创票据）	3.36	180D	10.00	AAA	—
23 中建投租 SCP005	2.60	180D	5.00	AAA	—
23 皖国控 SCP001	3.20	180D	3.00	AA	—
23 湘高速 SCP010	2.55	198D	10.00	AAA	—
23 冀中能源 SCP010	3.96	240D	20.00	AAA	—
23 大唐租赁 SCP010	2.70	240D	15.00	AAA	—
23 湘高速 SCP011	2.63	240D	10.00	AAA	—
23 湘高速 SCP012	2.63	240D	10.00	AAA	—
23 鄂联投 SCP004	2.80	240D	9.00	AAA	—
23 华电租赁 SCP009	2.66	240D	6.00	AAA	—
23 宿迁交通 SCP003	2.65	240D	1.50	AA+	—
23 津渤海 SCP019	3.38	250D	8.00	AAA	—
23 海通恒信 SCP008	2.81	268D	10.00	AAA	—
23 越秀租赁 SCP012	2.70	268D	6.00	AAA	—
23 浙能源 SCP004	2.43	269D	10.00	AAA	—
23 长发集团 SCP002	2.97	269D	10.00	AAA	—
23 深业 SCP005	2.58	270D	20.00	AAA	—
23 深圳地铁 SCP008	2.45	270D	20.00	AAA	—
23 越秀集团 SCP011	2.54	270D	15.00	AAA	—
23 济南高新 SCP007	2.83	270D	12.00	AAA	—
23 杭商贸 SCP003	2.57	270D	10.00	AAA	—
23 淮南矿 SCP003	2.69	270D	10.00	AAA	—
23 桂铁投 SCP003	2.87	270D	7.90	AAA	—
23 天津轨交 SCP020	2.87	270D	7.00	AAA	—
23 穗自来水 SCP003	2.47	270D	6.00	AAA	—
23 滨建投 SCP037	2.95	270D	6.00	AAA	—

23 常城建 SCP007	2.60	270D	5.60	AAA	—
23 宁夏国资 SCP002	2.80	270D	4.00	AAA	—
23 昆山国创 SCP004	2.69	270D	10.00	AA+	—
23 温州交通 SCP002	2.64	270D	10.00	AA+	—
23 广州高新 SCP007	2.68	270D	10.00	AA+	—
23 宣城国资 SCP007	2.80	270D	10.00	AA+	—
23 中铝资本 SCP005	2.72	270D	7.00	AA+	—
23 晋江城投 SCP003	2.85	270D	5.10	AA+	—
23 湖州产投 SCP003	3.01	270D	5.00	AA+	—
23 盐城国投 SCP003	3.00	270D	5.00	AA+	—
23 武进经发 SCP010	2.80	270D	5.00	AA+	—
23 泉州文旅 SCP002	2.80	270D	5.00	AA+	—
23 吴江交投 SCP001	2.73	270D	4.00	AA+	—
23 碧水源 SCP008（科创票据）	3.20	270D	4.00	AA+	—
23 扬州交通 SCP001	2.68	270D	3.40	AA+	—
23 东阳光 SCP008	6.70	270D	3.00	AA+	—
23 镇国投 SCP004	2.89	270D	3.00	AA+	—
23 吴中城投 SCP007	2.84	270D	2.00	AA+	—
23 宁夏农垦 SCP009（乡村振兴）	3.13	270D	2.00	AA+	—
23 西青经开 SCP002	2.80	270D	1.70	AA+	—
23 泸州产业 SCP002	3.28	270D	13.00	AA	A-1
23 海安经开 SCP005	3.10	270D	10.00	AA	—
23 浦口交通 SCP004	2.99	270D	7.00	AA	—
23 温州交运 SCP003	2.98	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 一汽租赁 CP006	2.76	354D	10.00	AAA	—
23 一汽租赁 CP007	2.77	364D	10.00	AAA	—
23 水发集团 CP002	3.27	366D	15.00	AAA	—
23 青岛城投 CP002	2.84	366D	10.00	AAA	—
23 平煤化 CP001	3.50	366D	5.00	AAA	—
23 海安开投 CP001	2.92	366D	5.00	AA+	—
23 牛首山 CP002	3.00	366D	5.00	AA	—
23 扬州新材 CP002	3.00	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 云铁投 MTN002	3.98	1.49	6.00	AA+	—
23 云投 MTN003	3.66	1.49	20.00	AAA	—
23 兖矿能源 MTN002（科创票据）	3.16	2.00	30.00	AAA	AAA
23 中电投 MTN046	2.66	2.00	21.00	AAA	—
23 云能投 MTN004	3.60	2.00	20.00	AAA	—
23 晋能煤业 MTN010	3.50	2.00	20.00	AAA	AAA
23 京能源 MTN003	2.99	2.00	20.00	AAA	—
23 大唐集 MTN022	2.99	2.00	15.00	AAA	AAA

23 金隅 MTN006	3.16	2.00	15.00	AAA	AAA
23 平安租赁 MTN006	3.80	2.00	15.00	AAA	-
23 中铝国工 MTN002	3.77	2.00	13.00	AAA	AAA
23 中化股 MTN004	3.12	2.00	10.00	AAA	-
23 特变股份 MTN003	3.78	2.00	10.00	AAA	-
23 五矿集 MTN003	3.17	2.00	10.00	AAA	-
23 皖交控 MTN006	3.12	2.00	10.00	AAA	-
23 济南高新 MTN005A	3.20	2.00	10.00	AAA	AAA
23 美的置业 MTN005B	5.16	2.00	8.00	AAA	AAA
23 中电路桥 MTN001	3.18	2.00	7.00	AAA	AAA
23 国药租赁 MTN002	3.35	2.00	6.00	AAA	-
23 洋河 MTN003	3.14	2.00	5.00	AAA	-
23 凯盛科技 MTN001	3.45	2.00	5.00	AAA	AAA
23 悦达 MTN003	3.95	2.00	5.00	AAA	-
23 美的置业 MTN005A	4.60	2.00	2.00	AAA	AAA
23 中交天航 MTN003（科创票据）	3.50	2.00	10.00	AA+	AA+
23 佛燃能源 MTN001	3.20	2.00	8.00	AA+	-
23 淮安开发 MTN001	2.99	2.00	5.00	AA+	-
23 天辰工程 MTN001（科创票据）	3.00	2.00	5.00	AA+	AA+
23 广西旅发 MTN003	4.00	2.00	5.00	AA+	-
23 郴投集团 MTN002	3.68	2.00	5.00	AA+	-
23 汇金 MTN006A（增发1）	2.80	3.00	150.00	AAA	-
23 光大环境 MTN003	3.21	3.00	20.00	AAA	AAA
23 晋能电力 MTN018	3.25	3.00	20.00	AAA	-
23 兴城投资 MTN002	3.35	3.00	20.00	AAA	AAA
23 中建投资 MTN001	3.50	3.00	20.00	AAA	AAA
23 中航产融 MTN001（科创票据）	3.08	3.00	15.00	AAA	AAA
23 中建四局 MTN001（科创票据）	3.70	3.00	13.00	AAA	AAA
23 临港经济 MTN003	3.35	3.00	10.00	AAA	AAA
23 浙国贸 MTN001	3.20	3.00	10.00	AAA	-
23 北部湾 MTN007	3.64	3.00	10.00	AAA	-
23 洪市政 MTN001	3.05	3.00	10.00	AAA	-
23 中国电子 MTN003	2.95	3.00	10.00	AAA	-
23 吴江城投 MTN001	3.03	3.00	10.00	AAA	-
23 华发实业 MTN004B	3.46	3.00	6.00	AAA	AAA
23 卓越商业 MTN003	4.50	3.00	5.00	AAA	-
23 泰州城建 MTN004	3.17	3.00	2.00	AAA	-
23 运城城投 MTN003	3.65	3.00	10.00	AA+	AA+
23 阜阳建投 MTN001	3.36	3.00	9.00	AA+	-
23 顺德投资 MTN002	3.55	3.00	7.00	AA+	-
23 华银电力 MTN001（能源保供特别债）	3.93	3.00	5.00	AA+	-
23 文登蓝海 MTN001	5.50	3.00	4.20	AA+	-
23 亚盛实业 MTN001（乡村振兴）	4.00	3.00	8.00	AA	AAA
23 扬州绿产 MTN001	3.55	3.00	4.00	AA	-

23 广州地铁 MTN007	3.07	5.00	25.00	AAA	AAA
23 广核国际 MTN001	3.11	5.00	20.00	AAA	AAA
23 光大集团 MTN002	3.08	5.00	20.00	AAA	AAA
23 济南高新 MTN005B	3.40	5.00	10.00	AAA	AAA
23 川投资 MTN002	2.97	5.00	10.00	AAA	—
23 金融街 MTN008	3.54	5.00	8.00	AAA	AAA
23 大横琴 MTN003A	3.45	5.00	6.00	AAA	AAA
23 闽高速 MTN003	3.10	5.00	5.00	AAA	—
23 华发实业 MTN004A	4.30	5.00	4.00	AAA	AAA
23 武汉水务 MTN001	3.40	5.00	5.00	AA+	—
23 滨州财金 MTN002	3.75	5.00	3.70	AA+	—
23 镇江新城 MTN002	3.70	5.00	5.50	AA	AAA
23 高邮水务 MTN001	3.60	5.00	4.50	AA	—
23 寿光金鑫 MTN002	5.80	5.00	4.00	AA	—
23 联发集 MTN003	3.85	6.00	10.00	AA+	AAA
23 京国资 MTN001A	3.22	10.00	15.00	AAA	AAA
23 常城建 MTN008	3.70	10.00	10.00	AAA	AAA
23 大横琴 MTN003B	4.19	10.00	4.00	AAA	AAA
23 京国资 MTN001B	3.32	15.00	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，收益率有所上行。AAA 级短期融资券中，1 个月品种收益率较前周上行 7BP，上周收于 2.42%；6 个月品种收益率较前周上行 6BP，上周收于 2.75%；1 年期品种收益率较前周上行 14BP，上周收于 2.92%。
- 中期票据方面，收益率小幅震荡。AAA 级中期票据中，3 年期品种收益率较前周上行 6BP，上周收于 3.09%；5 年期品种收益率较前周下行 5BP，上周收于 3.20%。
- 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上行 6BP，上周收于 2.91%；5 年期品种收益率较前周上行 2BP，上周收于 3.07%；10 年期品种收益率较前周下行 3BP，上周收于 3.11%。

◆ 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 3.1BP，上周收于 4.467%。
- 德国国债价格下跌，10 年期德国国债收益率较前周上行 5.5BP，上周收于 2.643%。

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	4.948	6.3	-13.9	52.2
5 年	4.485	4.4	-36.9	48.1
10 年	4.467	3.1	-46.4	59.2
30 年	4.597	0.8	-49.6	63.4
德国国债				
2 年	3.072	10.8	5.6	30.8
5 年	2.616	8.5	-3.9	3.8
10 年	2.643	5.5	-16.3	7.2
30 年	2.819	1.7	-27.5	27.4

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 2.55BP，上周收于 4.1185%。

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	4.7460	4.10	-22.29	30.00
10 年	4.1185	2.55	-45.07	56.10
30 年	3.9330	1.56	-44.35	72.45

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周上涨 1.11%，上周最高 2007.29 美元/盎司、最低 1964.70 美元/盎司，收于 2001.97 美元/盎司。
- 白银价格较前周上涨 2.40%，上周最高 24.34 美元/盎司、最低 23.22 美元/盎司，收于 24.30 美元/盎司。
- 铂金价格较前周上涨 3.52%，上周最高 940.90 美元/盎司、最低 892.08 美元/盎司，收于 930.61 美元/盎司。
- 钯金价格较前周上涨 1.51%，上周最高 1090.74 美元/盎司、最低 1037.08 美元/盎司，收于 1068.83 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	2001.97	1.11%	0.97%
白银	24.30	2.40%	6.11%
铂金	930.61	3.52%	-0.33%
钯金	1068.83	1.51%	-4.15%

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 1.18%，上周最高 78.46 美元/桶、最低 73.79 美元/桶，收于 75.18 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周下跌 0.34%，上周最高 82.85 美元/桶、最低 78.48 美元/桶，收于 80.15 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	75.18	-1.18%	-7.07%
ICE Brent 主力合约	80.15	-0.34%	-5.64%

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 1.58%，上周最高 8486.00 美元/吨、最低 8275.00 美元/吨，收于 8440.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周上涨 0.41%，上周最高 2264.00 美元/吨、最低 2211.00 美元/吨，收于 2225.00 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	8440.00	1.58%	3.95%
LME 3 月铝	2225.00	0.41%	-0.98%

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 1.02%，上周最高 1389.25 美分/蒲式耳、最低 1327.00 美分/蒲式耳，收于 1330.25 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)	578.75	0.26%	-1.28%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1330.25	-1.02%	1.43%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	482.75	-0.67%	-2.18%
ICE 棉花(美分/磅)	81.05	-0.31%	-2.99%
ICE 白糖(美分/磅)	26.88	-1.18%	-0.85%

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 4.28%，上周最高 3.134 美元/百万英热单位、最低 2.933 美元/百万英热单位，收于 2.996 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	2.996	-4.28%	-22.08%

数据来源：路透