

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	15
贵金属市场上周概览	17
原油市场上周概览	18
基本金属市场上周概览	19
农产品市场上周概览	20
天然气市场上周概览	21

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7.1167，较前周贬值约0.16%；银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.44%，上周收于7.1938；1年期掉期点较前周下行50个点，上周收于-2465。
 - ✓ 1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行380个点，上周收于7.0170。
- **外币汇率市场上周概览**
 - ✓ 美元指数较前周上涨0.86%，上周收于103.288。
 - ✓ 欧元兑美元较前周下跌0.47%，上周收于1.0897。
 - ✓ 美元兑日元较前周上涨2.24%，上周收于148.14。
 - ✓ 澳元兑美元较前周下跌1.32%，上周收于0.6597。
- **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1.72%和1.86%，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1.83%和2.15%。
 - ✓ 二级市场：10年期国债收益率较前周下行2BP，上周收于2.55%；5年期国开债收益率较前周下行3BP，上周收于2.47%。
 - ✓ 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3年、5年、7年和10年期固息债；进出口行招标发行1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113支，规模合计1101.09亿元；短期融资券18支，规模合计121.63亿元；中期票据88支，规模合计774.60亿元。
 - ✓ 二级市场：短期融资券震荡上行，中期票据收益率震荡下行，企业债收益率区间震荡。
- **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18.4BP，上周收于4.123%。
 - ✓ 德国国债价格下跌，10年期德国国债收益率较前周上行15.8BP，上周收于2.342%。
- **贵金属市场上周概览**
 - ✓ 黄金价格较前周下跌0.96%，上周收于2029.09美元/盎司。
 - ✓ 白银价格较前周下跌2.53%，上周收于22.58美元/盎司。
 - ✓ 铂金价格较前周下跌0.63%，上周收于899.83美元/盎司。
 - ✓ 钯金价格较前周下跌2.96%，上周收于946.45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0.75%，上周收于73.43美元/桶。
 - ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周上涨0.40%，上周收于78.63美元/桶。
- **基本金属市场上周概览**
 - ✓ LME3月期铜价格较前周上涨1.02%，上周收于8380.00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1.00%，上周收于1214.00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24.38%，上周收于2.519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（1月19日）报 7.1167，较前周贬值约 0.16%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.44%，上周最高 7.1650、最低 7.1999，收于 7.1938，波幅为 0.49%。
- 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 50 个点，上周最高-2360、最低-2466，收于-2465，波幅为 4.30%。
- 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 380 个点，上周最高 7.0410、最低 6.9545，收于 7.0170，波幅为 1.23%。

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	—	—	7.1167	117	340	340
银行间市场汇价	7.1999	7.1650	7.1938	316	1018	1018
掉期点						
1 个月期限	-209	-231	-214	22	-6	-6
2 个月期限	-410	-432	-430	-5	-7	-7
3 个月期限	-621	-636	-633	-8	2	2
6 个月期限	-1222	-1275	-1263	-29	-15	-15
1 年期限	-2360	-2466	-2465	-50	-50	-50

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	7.1465	7.0836	7.1130	145	395	-594
2 个月期限	7.1405	7.0743	7.1110	185	485	-398
3 个月期限	7.1320	7.0668	7.1055	220	565	-250
6 个月期限	7.1005	7.0271	7.0765	280	650	90
1 年期限	7.0410	6.9545	7.0170	380	685	697

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 0.86%，上周最高 103.692、最低 102.313，收于 103.288。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.47%，上周最高 1.0967、最低 1.0843，收于 1.0897。
- 美元兑日元较前周上涨 2.24%，上周最高 148.80、最低 144.85，收于 148.14。
- 澳元兑美元较前周下跌 1.32%，上周最高 0.6704、最低 0.6523，收于 0.6597。

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	103.288	0.86%	1.93%
欧元/美元	1.0897	-0.47%	-1.26%
美元/日元	148.14	2.24%	5.02%
澳元/美元	0.6597	-1.32%	-3.13%

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 1.72%和 1.86%，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 1.83%和 2.15%。央行公开市场方面，上周一（1 月 15 日）进行 7 天期逆回购操作 890 亿元和 1 年期中期借贷便利（MLF）操作 9950 亿元，当日有逆回购到期 500 亿元；上周二（1 月 16 日）进行 7 天期逆回购操作 7600 亿元，当日分别有逆回购到期 650 亿元和 MLF 到期 7790 亿元；上周三（1 月 17 日）进行 7 天期回购操作 5470 亿元，当日有逆回购到期 200 亿元；上周四（1 月 18 日）进行 7 天期逆回购操作 1000 亿元，当日有逆回购到期 270 亿元；上周五进行 7 天期逆回购操作 710 亿元，当日有逆回购到期 650 亿元。本周（1 月 22 日-1 月 26 日）将有逆回购到期 15670 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)	1.72	5	-2
7 天 Shibor (1W)	1.83	-2	-4
3 月期 Shibor (3M)	2.40	0	-13
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.86	3	-5
7 天回购定盘利率 (FR007)	2.15	-5	-25

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，收益率小幅下行。1 年期国债收益率较前周下行 1BP，上周收于 2.08%；5 年期国债收益率较前周下行 3BP，上周收于 2.39%；10 年期国债收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.55%。
- 政策性金融债方面，收益率小幅下行。1 年期国开债收益率较前周下行 3BP，上周收于 2.19%；5 年期国开债收益率较前周下行 3BP，上周收于 2.47%；10 年期国开债收益率较前周下行 3BP，上周收于 2.70%。

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	2.08	-1	0
3 年期	2.28	-2	0
5 年期	2.39	-3	0
7 年期	2.50	-3	-3
10 年期	2.55	-2	-3

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	2.19	-3	-1
3 年期	2.38	-4	3
5 年期	2.47	-3	1
7 年期	2.65	-3	-2
10 年期	2.70	-3	-1

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 10 年期付息国债。
上周四财政部招标发行 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。上周二农发行招标发行 2 年和 7 年期固息债；国开行招标发行 3 年和 5 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、7 年和 10 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，收益率小幅震荡。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 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波动-1BP 至 3BP；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	2.16	5	13
6 月期	2.12	5	13
9 月期	2.08	4	9
1 年期	2.07	4	8
3 年期	2.15	2	3
4 年期	2.22	1	0
5 年期	2.29	0	-3
7 年期	2.41	0	-3
10 年期	2.56	0	-3
3 月 Shibor（ACT/360）			
6 月期	2.36	1	-2
9 月期	2.33	2	1
1 年期	2.32	3	4
2 年期	2.32	0	2
3 年期	2.37	-1	-1
4 年期	2.45	-1	-2
5 年期	2.54	-1	-4
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 113 支，规模合计 1101.09 亿元；短期融资券 18 支，规模合计 121.63 亿元；中期票据 88 支，规模合计 774.60 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限震荡下行 0BP 至 3BP。

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
24 陕西金控 SCP001	2.48	60D	10.00	AAA	—
24 赣能 SCP001 (科创票据)	2.50	60D	3.00	AA+	—
24 华光环保 SCP001 (科创票据)	2.56	60D	1.00	AA+	—
24 首旅 SCP001	2.21	64D	12.00	AAA	—
24 首旅 SCP002	2.21	64D	12.00	AAA	—
24 苏州高新 SCP002	2.30	64D	2.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP016	2.31	70D	20.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP015	2.31	70D	20.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP014	2.31	70D	15.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP017	2.31	70D	10.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP018	2.31	70D	5.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP010	2.31	71D	15.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP011	2.31	71D	15.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP012	2.31	71D	15.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP013	2.31	71D	15.00	AAA	—
24 伊利实业 SCP007	2.19	74D	30.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP007	2.28	74D	15.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP008	2.28	74D	15.00	AAA	—
24 中电路桥 SCP001	2.19	74D	12.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP009	2.28	74D	10.00	AAA	—
24 招商局 SCP002	2.14	88D	50.00	AAA	—
24 龙源电力 SCP002	2.17	90D	20.00	AAA	—
24 中国信科 SCP001	2.40	90D	15.00	AAA	—
24 大唐租赁 SCP001	2.42	90D	10.00	AAA	—
24 大横琴 SCP001	2.52	90D	10.00	AAA	—
24 江苏广电 SCP001 (科创票据)	2.26	90D	5.00	AAA	—
24 滨湖建设 SCP001	2.50	90D	2.00	AA+	—
24 高淳建设 CP001	2.70	90D	5.00	AA	—
24 沪电力 SCP001	2.31	93D	10.00	AAA	—
24 宁沪高 SCP001	2.26	93D	10.00	AAA	—
24 象屿股份 SCP001	2.39	93D	10.00	AAA	—

24 宁沪高 SCP003	2.26	93D	5.00	AAA	—
24 宁沪高 SCP002	2.26	93D	5.00	AAA	—
24 中拓 SCP001	2.61	93D	5.00	AA+	—
24 航天电子 SCP001	2.35	120D	5.00	AA+	—
24 浙江建投 SCP001	2.99	120D	5.00	AA+	—
24 苏交通 SCP003	2.33	130D	20.00	AAA	—
24 杭州热联 SCP002	2.65	130D	10.00	AA+	—
24 蒙牛 SCP003	2.28	147D	29.00	AAA	—
24 厦国贸 SCP003	2.36	149D	17.00	AAA	—
24 珠海港股 SCP001	2.42	157D	4.00	AA+	—
24 中建一局 SCP001（科创票据）	2.30	158D	15.00	AAA	—
24 中建一局 SCP002（科创票据）	2.30	158D	15.00	AAA	—
24 海淀国资 SCP003	2.68	160D	30.00	AAA	—
24 徐工集团 SCP002	2.34	164D	4.00	AAA	—
24 徐工集团 SCP003	2.34	164D	4.00	AAA	—
24 徐工集团 SCP001	2.34	164D	3.00	AAA	—
24 平安租赁 SCP001	2.65	170D	10.00	AAA	—
24 苏州高新 SCP003	2.40	170D	3.00	AAA	—
24 远东租赁 SCP001	2.83	177D	10.00	AAA	—
24 龙盛 SCP001（科创票据）	2.64	177D	5.50	AAA	—
24 皖能股 SCP001	2.38	178D	10.00	AAA	—
24 中交一公 SCP001	2.32	180D	20.00	AAA	—
24 中交建 SCP002	2.23	180D	20.00	AAA	—
24 隧道股份 SCP001	2.27	180D	15.00	AAA	—
24 广州工投 SCP001	2.48	180D	15.00	AAA	—
24 甘国投 SCP001	2.59	180D	10.00	AAA	—
24 平安租赁 SCP002	2.67	180D	10.00	AAA	—
24 广州港 SCP002	2.26	180D	9.00	AAA	—
24 临沂城投 SCP001	2.53	180D	5.05	AAA	—
24 苏州资产 SCP002	2.50	180D	3.00	AAA	—
24 川华西 SCP001	2.75	180D	10.00	AA+	—
24 沪数据港 SCP001（科创票据）	2.29	180D	5.00	AA+	—
24 渝医药 SCP001	2.83	180D	5.00	AA+	—
24 上饶创新 SCP001	2.80	180D	5.00	AA+	—
24 威宁投资 SCP001	3.04	180D	3.00	AA+	—
24 镇江旅游 CP001	2.84	180D	3.20	AA	—
24 皖能源 SCP001	2.32	181D	11.00	AAA	—
24 锦江国际 SCP001	2.39	200D	20.00	AAA	—
24 南昌轨交 SCP001	2.44	200D	5.50	AAA	—
24 中航租赁 SCP001	2.48	226D	10.00	AAA	—
24 中交城投 SCP001	2.60	226D	10.00	AAA	—
24 华侨城 SCP001	2.75	245D	25.00	AAA	—
24 珠海港 SCP001	2.69	250D	5.00	AA+	—
24 海通恒信 SCP001	2.65	252D	10.00	AAA	—

24 融和融资 SCP002	2.47	255D	5.00	AAA	—
24 海淀国资 SCP002	2.73	256D	10.00	AAA	—
24 江苏资产 SCP001	2.51	266D	3.00	AAA	—
24 鲁钢铁 SCP001	2.56	268D	10.00	AAA	—
24 杭州能源 SCP001	2.29	268D	3.00	AAA	—
24 保利发展 CP001	2.49	270D	25.00	AAA	—
24 北控 SCP001	2.47	270D	20.00	AAA	—
24 青岛地铁 SCP001	2.60	270D	19.00	AAA	—
24 陕西建工 SCP001	3.45	270D	10.00	AAA	—
24 广东农垦 SCP001	2.38	270D	10.00	AAA	—
24 南山集 SCP001（科创票据）	4.30	270D	10.00	AAA	—
24 泉州城建 SCP001	2.55	270D	7.00	AAA	—
24 泰达投资 SCP001	2.90	270D	5.60	AAA	—
24 泰州城建 SCP002	2.56	270D	5.00	AAA	—
24 中核汇能 SCP001	2.67	270D	5.00	AAA	—
24 常城建 SCP002	2.40	270D	5.00	AAA	—
24 悦达 SCP002	2.90	270D	5.00	AAA	—
24 津地铁 SCP001	2.74	270D	5.00	AAA	—
24 南昌轨交 SCP002	2.45	270D	4.50	AAA	—
24 越秀交通 SCP001	2.61	270D	2.00	AAA	—
24 榆林城投 SCP001	2.73	270D	15.00	AA+	—
24 湘建工 SCP001（科创票据）	2.75	270D	10.00	AA+	—
24 新业国资 SCP001	2.85	270D	5.00	AA+	—
24 扬州经开 SCP001	2.53	270D	5.00	AA+	—
24 邯郸城投 SCP001	2.73	270D	5.00	AA+	—
24 克拉玛依 SCP001	2.70	270D	5.00	AA+	—
24 海安开投 SCP001	2.76	270D	3.60	AA+	—
24 衢通发展 SCP001	2.52	270D	3.00	AA+	—
24 鲁商 SCP001	4.00	270D	3.00	AA+	—
24 青城租赁 SCP001	3.40	270D	3.00	AA+	—
24 驻马店投 SCP001	2.73	270D	2.53	AA+	—
24 桐昆控股 SCP001	2.91	270D	2.00	AA+	—
24 吴中城投 SCP002	2.65	270D	2.00	AA+	—
24 莆田国资 SCP001	2.76	270D	5.00	AA	—
24 淮安淮安 SCP001	2.88	270D	4.11	AA	—
24 宿迁经开 SCP001	2.75	270D	4.00	AA	—
24 南宁高新 SCP001	3.00	270D	4.00	AA	—
24 金坛投资 SCP001	2.88	270D	2.50	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
24 云能投 CP001	2.80	300D	15.00	AAA	—
24 云投 CP003	2.87	330D	20.00	AAA	—
24 大兴发展 CP001	2.36	366D	17.20	AAA	—
24 云投 CP002	2.90	366D	10.00	AAA	—

24 陕西金融 CP001	2.83	366D	9.00	AAA	—
24 龙城发展 CP001	2.65	366D	5.00	AAA	—
24 青岛海控 CP001	2.73	366D	5.00	AAA	—
24 泉州城建 CP001	2.55	366D	3.00	AAA	—
24 凤城河 CP001	2.59	366D	5.00	AA+	—
24 保利久联 CP001	3.79	366D	3.00	AA+	—
24 扬州经开 CP001	2.58	366D	2.00	AA+	—
24 西汇投资 CP001	2.90	366D	10.00	AA	—
24 海安经开 CP001	2.86	366D	5.00	AA	—
24 苏海投资 CP001	2.95	366D	4.00	AA	—
24 江苏新投 CP001	2.90	366D	3.50	AA	—
24 宁国建投 CP001	2.90	366D	3.26	AA	—
24 吉安城建 CP001	2.88	366D	1.27	AA	—
24 安东控股 CP001	3.01	366D	0.40	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
24 徐州高新 MTN001	2.80	1.21	4.50	AA	—
24 云能投 MTN002	3.19	2.00	20.00	AAA	—
24 大横琴 MTN001	3.00	2.00	10.00	AAA	AAA
24 华阳新材 MTN002	2.80	2.00	10.00	AAA	—
24 武金控 MTN001	3.31	2.00	9.00	AAA	—
24 滨建投 MTN001	3.08	2.00	5.00	AAA	AAA
24 中核租赁 MTN001 (碳中和债)	2.85	2.00	5.00	AAA	AAA
24 鲁宏桥 MTN001	4.00	2.00	10.00	AA+	AA+
24 乌交旅 MTN001	3.60	2.00	6.00	AA+	—
24 晋交投 MTN002	2.85	2.00	5.00	AA+	—
24 云天化 MTN001 (科创票据)	3.70	2.24	5.00	AA+	—
24 华侨城 MTN001	3.57	3.00	21.00	AAA	AAA
24 晋能煤业 MTN002	3.04	3.00	20.00	AAA	—
24 皖投集 MTN001	2.82	3.00	20.00	AAA	—
24 津城建 MTN005	3.65	3.00	20.00	AAA	—
24 鲁高速 MTN001	2.99	3.00	15.00	AAA	AAA
24 水发集团 GN001	3.67	3.00	11.00	AAA	—
24 南昌轨交 MTN001 (绿色)	2.84	3.00	10.00	AAA	—
24 广州工控 MTN001	2.85	3.00	10.00	AAA	—
24 广州资管 MTN001	2.90	3.00	10.00	AAA	—
24 四川机场 MTN001 (可持续挂钩)	2.76	3.00	10.00	AAA	—
24 乌城投 MTN001A	2.90	3.00	10.00	AAA	—
24 冀中能源 MTN002A (科创票据)	3.00	3.00	8.00	AAA	—
24 宁河西 MTN001	3.05	3.00	8.00	AAA	—
24 冀中能源 MTN002B (科创票据)	4.16	3.00	7.00	AAA	—
24 淮安国投 MTN001	2.96	3.00	6.20	AAA	—
24 皖铁基金 MTN001	2.94	3.00	5.00	AAA	—
24 株洲城建 MTN001	3.13	3.00	12.00	AA+	—

24 先行控股 MTN001	2.97	3.00	10.00	AA+	—
24 景国资 MTN001	3.46	3.00	10.00	AA+	—
24 郑州公用 MTN001	2.97	3.00	8.70	AA+	—
24 株洲高科 MTN001	3.65	3.00	8.00	AA+	—
24 宜兴城投 MTN002	2.91	3.00	8.00	AA+	—
24 青岛北发 MTN001	3.09	3.00	6.50	AA+	—
24 大江北 MTN003	2.98	3.00	6.00	AA+	—
24 南浦口 MTN001	3.00	3.00	6.00	AA+	—
24 淮北建投 MTN002	3.20	3.00	5.00	AA+	—
24 山西文旅 MTN001	4.37	3.00	5.00	AA+	—
24 芜湖宜居 MTN001	2.90	3.00	4.80	AA+	—
24 新疆金投 MTN001	3.28	3.00	4.00	AA+	—
24 新海连 MTN001	3.07	3.00	4.00	AA+	—
24 红豆 MTN001（科创票据）	3.35	3.00	3.00	AA+	AAA
24 北方企业 MTN001	3.00	3.00	2.00	AA+	—
24 齐梁建设 MTN001	3.28	3.00	7.00	AA	—
24 丰县建投 MTN001	3.50	3.00	6.00	AA	—
24 瀛洲发展 MTN001	3.20	3.00	5.50	AA	—
24 张保实业 MTN001	3.08	3.00	5.00	AA	—
24 龙岩投资 MTN001	3.30	3.00	3.00	AA	—
24 广投金控 MTN001	4.60	3.00	1.00	AA	—
24 南京新港 MTN001	3.10	4.00	7.00	AA+	—
24 广州地铁 MTN001	2.88	5.00	25.00	AAA	AAA
24 金桥集团 MTN001	2.96	5.00	20.00	AAA	—
24 渝高速 MTN001	2.97	5.00	15.00	AAA	—
24 陕延油 MTN003	3.17	5.00	15.00	AAA	AAA
24 徐州新盛 MTN003	3.01	5.00	10.00	AAA	—
24 蜀道投资 MTN001	2.89	5.00	10.00	AAA	—
24 武汉地铁 MTN001	2.92	5.00	10.00	AAA	—
24 青岛国信 MTN001	3.00	5.00	10.00	AAA	—
24 乌城投 MTN001B	3.15	5.00	10.00	AAA	—
24 扬城建 MTN002	3.03	5.00	9.00	AAA	—
24 杭城投 MTN002A	2.78	5.00	7.00	AAA	AAA
24 国联 MTN001	2.97	5.00	6.00	AAA	—
24 沈阳地铁 MTN001	2.98	5.00	5.00	AAA	—
24 安琪生物 MTN001	2.82	5.00	5.00	AAA	—
24 扬城建 MTN001	3.03	5.00	5.00	AAA	—
24 广安控股 MTN001	2.90	5.00	20.00	AA+	—
24 国宏投资 MTN001（科创票据）	3.40	5.00	10.00	AA+	—
24 常德经建 MTN001	3.14	5.00	8.60	AA+	—
24 温州现代 MTN001	3.00	5.00	7.00	AA+	—
24 济宁城投 MTN002B	3.48	5.00	6.00	AA+	—
24 鑫泰 MTN001	3.20	5.00	5.30	AA+	—
24 武汉水务 MTN001	3.10	5.00	5.00	AA+	—

24 余姚城投 MTN001	3.05	5.00	4.35	AA+	—
24 富皋万泰 MTN001	3.14	5.00	3.20	AA+	—
24 济宁城投 MTN002A	3.10	5.00	2.50	AA+	—
24 宜昌交旅 MTN001	3.45	5.00	10.00	AA	AA
24 新滨江 MTN001	3.30	5.00	7.00	AA	—
24 綦江新城 MTN001	4.50	5.00	5.00	AA	AA
24 硃口国资 MTN001	3.20	5.00	4.18	AA	—
24 巴中国资 MTN001	5.45	5.00	3.27	AA	—
24 联发集 MTN001	3.39	6.00	10.00	AA+	AAA
24 天恒置业 MTN001	3.93	7.00	6.00	AA+	AA+
24 诚通控股 MTN002A	3.30	10.00	20.00	AAA	AAA
24 江西交投 MTN002	3.05	10.00	15.00	AAA	AAA
24 陕煤化 MTN001	3.29	10.00	10.00	AAA	AAA
24 杭城投 MTN002B	3.00	10.00	3.00	AAA	AAA
24 淄博城运 MTN001（项目收益）	3.19	13.00	9.00	AAA	—
24 诚通控股 MTN002B	3.47	20.00	20.00	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 4BP，上周收于 2.44%；6 个月品种收益率较前周上行 6BP，上周收于 2.66%；1 年期品种收益率较前周上行 6BP，上周收于 2.76%。
- 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 3BP，上周收于 2.78%；5 年期品种收益率与前周持平，上周收于 2.97%。
- 企业债方面，收益率区间震荡。AAA 级企业债中，3 年期品种收益率较前周上行 1BP，上周收于 2.73%；5 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.84%；10 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.95%。

◆ 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 18.4BP，上周收于 4.123%。
- 德国国债价格下跌，10 年期德国国债收益率较前周上行 15.8BP，上周收于 2.342%。

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	4.385	24.0	13.5	13.5
5 年	4.051	22.1	20.4	20.4
10 年	4.123	18.4	24.4	24.4
30 年	4.329	15.3	30.0	30.0
德国国债				
2 年	2.738	22.1	33.4	33.4
5 年	2.281	20.3	33.3	33.3
10 年	2.342	15.8	31.8	31.8
30 年	2.492	9.7	22.9	22.9

数据来源：彭博

◆ 外币利率市场上周概览——利率掉期市场

- 美元利率掉期率上行，10 年期美元利率掉期率较前周上行 20.82BP，上周收于 3.7558%。

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	4.2295	25.29	16.38	16.38
10 年	3.7558	20.82	28.18	28.18
30 年	3.6269	16.65	31.08	31.08

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周下跌 0.96%，上周最高 2058.49 美元/盎司、最低 2001.72 美元/盎司，收于 2029.09 美元/盎司。
- 白银价格较前周下跌 2.53%，上周最高 23.33 美元/盎司、最低 22.40 美元/盎司，收于 22.58 美元/盎司。
- 铂金价格较前周下跌 0.63%，上周最高 917.41 美元/盎司、最低 875.90 美元/盎司，收于 899.83 美元/盎司。
- 钯金价格较前周下跌 2.96%，上周最高 993.87 美元/盎司、最低 900.00 美元/盎司，收于 946.45 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	2029.09	-0.96%	-1.62%
白银	22.58	-2.53%	-4.97%
铂金	899.83	-0.63%	-8.86%
钯金	946.45	-2.96%	-13.84%

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上涨 0.75%，上周最高 74.63 美元/桶、最低 70.62 美元/桶，收于 73.43 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 0.40%，上周最高 79.73 美元/桶、最低 76.50 美元/桶，收于 78.63 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	73.43	0.75%	2.64%
ICE Brent 主力合约	78.63	0.40%	2.01%

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 1.02%，上周最高 8394.50 美元/吨、最低 8245.00 美元/吨，收于 8380.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周下跌 1.94%，上周最高 2230.00 美元/吨、最低 2158.50 美元/吨，收于 2172.50 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	8380.00	1.02%	-2.13%
LME 3 月铝	2172.50	-1.94%	-9.01%

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 1.00%，上周最高 1237.75 美分/蒲式耳、最低 1201.00 美分/蒲式耳，收于 1214.00 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)	593.25	-0.63%	-5.65%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1214.00	-1.00%	-6.44%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	445.25	-0.78%	-5.42%
ICE 棉花(美分/磅)	83.89	3.34%	3.63%
ICE 白糖(美分/磅)	23.56	8.92%	14.98%

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 24.38%，上周最高 3.189 美元/百万英热单位、最低 2.514 美元/百万英热单位，收于 2.519 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	2.519	-24.38%	0.88%

数据来源：路透