

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7.1059，较前周升值约0.01%；银行间市场人民币汇率与前周基本持平，上周收于7.1985；1年期掉期点较前周上行28个点，上周收于-2663。
 - ✓ 1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行100个点，上周收于7.0060。
- **外币汇率市场上周概览**
 - ✓ 美元指数较前周下跌0.07%，上周收于103.861。
 - ✓ 欧元兑美元较前周上涨0.18%，上周收于1.0837。
 - ✓ 美元兑日元较前周下跌0.26%，上周收于150.11。
 - ✓ 澳元兑美元较前周下跌0.56%，上周收于0.6523。
- **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1.69%和1.80%，7天上海银行间同业拆放利率（Shibor）和7天回购定盘利率分别收于1.81%和2.00%。
 - ✓ 二级市场：10年期国债收益率较前周下行2BP，上周收于2.42%；5年期国债收益率与前周持平，上周收于2.32%。
 - ✓ 一级市场：财政部招标发行91天、182天期贴现国债；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、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、7年和10年期固息债。
- **人民币信用债市场上周概览**
 - ✓ 一级市场：发行超短期融资券103支，规模合计1020.48亿元；短期融资券16支，规模合计119.51亿元；中期票据105支，规模合计1041.24亿元。
 - ✓ 二级市场：短期融资券、中期票据、企业债收益率均震荡下行。
- **外币利率市场上周概览**
 - ✓ 美国国债价格上涨，10年期美国国债收益率较前周下行6.8BP，上周收于4.180%。
 - ✓ 德国国债价格下跌，10年期德国国债收益率较前周上行5.1BP，上周收于2.414%。
- **贵金属市场上周概览**
 - ✓ 黄金价格较前周上涨2.34%，上周收于2083.39美元/盎司。
 - ✓ 白银价格较前周上涨0.92%，上周收于23.15美元/盎司。
 - ✓ 铂金价格较前周下跌1.76%，上周收于884.67美元/盎司。
 - ✓ 钯金价格较前周下跌1.61%，上周收于955.57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4.23%，上周收于79.81美元/桶。
 - ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周上涨3.36%，上周收于83.46美元/桶。
- **基本金属市场上周概览**
 - ✓ LME3月期铜价格较前周下跌0.43%，上周收于8522.00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0.55%，上周收于1149.75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上涨8.96%，上周收于1.836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（3月1日）报 7.1059，较前周升值约 0.01%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率与前周基本持平，上周最高 7.1876、最低 7.1996，收于 7.1985，波幅为 0.17%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五 16:30，1 年期掉期点较前周上行 28 个点，上周最高-2633、最低-2735，收于-2663，波幅为 3.83%。
- 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 100 个点，上周最高 7.0347、最低 6.9860，收于 7.0060，波幅为 0.70%。

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	—	—	7.1059	-5	23	232
银行间市场汇价	7.1996	7.1876	7.1985	1	55	1065
掉期点						
1 个月期限	-197	-250	-236	-30	4	-28
2 个月期限	-432	-474	-436	11	7	-13
3 个月期限	-638	-677	-650	4	0	-15
6 个月期限	-1308	-1375	-1327	21	1	-79
1 年期限	-2633	-2735	-2663	28	0	-248

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	7.1229	7.0817	7.1055	8	320	-694
2 个月期限	7.1158	7.0848	7.1025	29	400	-524
3 个月期限	7.1169	7.0797	7.0990	-15	500	-345
6 个月期限	7.1006	7.0474	7.0740	85	625	82
1 年期限	7.0347	6.9860	7.0060	100	575	738

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 0.07%，上周最高 104.292、最低 103.609，收于 103.861。
- 欧元兑美元较前周上涨 0.18%，上周最高 1.0865、最低 1.0794，收于 1.0837。
- 美元兑日元较前周下跌 0.26%，上周最高 150.84、最低 149.19，收于 150.11。
- 澳元兑美元较前周下跌 0.56%，上周最高 0.6568、最低 0.6485，收于 0.6523。

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	103.861	-0.07%	-0.28%
欧元/美元	1.0837	0.18%	0.31%
美元/日元	150.11	-0.26%	0.09%
澳元/美元	0.6523	-0.56%	0.43%

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 1.69%和 1.80%，7 天上海银行间同业拆放利率（Shibor）和 7 天回购定盘利率分别收于 1.81%和 2.00%。央行公开市场方面，上周一（2 月 26 日）进行逆回购操作 3290 亿元，逆回购到期 1370 亿元；上周二（2 月 27 日）进行逆回购操作 3840 亿元，逆回购到期 410 亿元；上周三（2 月 28 日）进行逆回购操作 3240 亿元，逆回购到期 490 亿元；上周四（2 月 29 日）进行逆回购操作 1170 亿元，逆回购到期 580 亿元；上周五进行逆回购操作 100 亿元，逆回购到期 2470 亿元。本周（3 月 4 日-3 月 8 日）将有逆回购到期 11640 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)	1.69	-5	6
7 天 Shibor (1W)	1.81	-1	3
3 月期 Shibor (3M)	2.18	-3	-1
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.80	-9	6
7 天回购定盘利率 (FR007)	2.00	-20	-5

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，收益率区间震荡。1 年期国债收益率较前周上行 1BP，上周收于 1.78%；5 年期国债收益率较前周上行 3BP，上周收于 2.27%；10 年期国债收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.42%。
- 政策性金融债方面，收益率区间震荡。1 年期国开债收益率较前周下行 5BP，上周收于 1.84%；5 年期国开债收益率与前周持平，上周收于 2.32%；10 年期国开债收益率较前周下行 8BP，上周收于 2.52%。

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	1.78	1	0
3 年期	2.15	1	4
5 年期	2.27	3	4
7 年期	2.38	-1	3
10 年期	2.42	-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	1.84	-5	0
3 年期	2.25	3	6
5 年期	2.32	0	4
7 年期	2.47	-2	5
10 年期	2.52	-8	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 91 天、182 天期贴现国债。
- 政策性金融债方面，上周农发行招标发行 3 年和 5 年期固息债。上周二国开行招标发行 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、2 年和 7 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区间波动-1BP 至 4BP；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 0BP 至 4BP；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	1.98	-1	-1
6 月期	1.97	2	0
9 月期	1.95	1	2
1 年期	1.95	2	2
3 年期	2.03	4	3
4 年期	2.11	4	4
5 年期	2.18	2	3
7 年期	2.31	3	3
10 年期	2.46	3	3
3 月 Shibor（ACT/360）			
6 月期	2.16	0	0
9 月期	2.14	3	3
1 年期	2.16	2	3
2 年期	2.17	1	3
3 年期	2.25	4	4
4 年期	2.33	3	4
5 年期	2.41	3	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 103 支，规模合计 1020.48 亿元；短期融资券 16 支，规模合计 119.51 亿元；中期票据 105 支，规模合计 1041.24 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 陕延油 SCP001	1.90	18D	30.00	AAA	—
24 吉林电力 SCP001	2.18	28D	10.00	AAA	—
24 中建五局 SCP001	2.02	29D	5.00	AAA	—
24 陕有色 SCP002	2.10	30D	10.00	AAA	—
24 中化国际 SCP001	2.00	31D	15.00	AAA	—
24 华能江苏 SCP001	1.99	45D	8.00	AAA	—
24 中建八局 SCP004	2.04	55D	30.00	AAA	—
24 甘肃能化 SCP001	2.55	60D	3.00	AA+	—
24 沪电力 SCP003	2.03	72D	17.00	AAA	—
24 蒙牛 SCP008	2.06	85D	29.00	AAA	—
24 蒙牛 SCP009	2.06	86D	29.00	AAA	—
24 中兴通讯 SCP023	2.18	86D	6.00	AAA	—
24 江苏广电 SCP003(科创票据)	2.10	87D	5.00	AAA	—
24 苏州高新 SCP008	2.14	88D	2.00	AAA	—
24 华能集 SCP001	1.96	90D	20.00	AAA	—
24 江铜 SCP007(科创票据)	2.04	90D	10.00	AAA	—
24 江铜 SCP006(科创票据)	2.04	90D	10.00	AAA	—
24 徐工集团 SCP004	2.04	90D	6.00	AAA	—
24 兴泰金融 SCP001	2.24	90D	3.00	AAA	—
24 蒙牛 SCP007	2.06	93D	29.00	AAA	—
24 南通城建 SCP001	2.14	93D	10.00	AAA	—
24 苏交通 SCP005	2.05	120D	20.00	AAA	—
24 中材科技 SCP001	2.11	120D	15.00	AAA	—
24 航天电子 SCP002	2.20	120D	10.00	AA+	—
24 宏信国资 SCP001	2.57	120D	5.96	AA	—
24 大众交通 SCP001	2.43	134D	10.00	AAA	—
24 蜀道投资 SCP001	2.25	150D	20.00	AAA	—
24 电网 SCP009	1.96	170D	50.00	AAA	—
24 武清国资 SCP002	2.50	170D	5.00	AA+	—
24 山东港口 SCP001	2.24	175D	15.00	AAA	—

24 杭州钢铁 SCP003	2.27	176D	10.00	AAA	—
24 上海机场 SCP005	2.07	176D	10.00	AAA	—
24 巨石 SCP001	2.12	177D	5.00	AAA	—
24 中拓 SCP004	2.29	177D	4.00	AA+	—
24 中集租赁 SCP001	2.54	178D	5.00	AA+	—
24 国际港务 SCP001	2.23	179D	5.00	AAA	—
24 中机公司 SCP001	2.60	179D	10.00	AA+	—
24 招商局 SCP003	1.96	180D	75.00	AAA	—
24 浙交投 SCP004	2.00	180D	20.00	AAA	—
24 广州地铁 SCP001	1.98	180D	20.00	AAA	—
24 杭商贸 SCP002	2.10	180D	10.00	AAA	—
24 南航集 SCP001	2.05	180D	6.60	AAA	—
24 龙盛 SCP003(科创票据)	2.38	180D	5.00	AAA	—
24 南航股 SCP001	2.08	180D	5.00	AAA	—
24 乐山国资 SCP001	2.45	180D	10.00	AA+	—
24 海晟控股 SCP001	2.45	180D	3.12	AA+	—
24 苏州水务 SCP001	2.42	180D	2.00	AA+	—
24 牛首山 SCP002	2.49	180D	5.20	AA	—
24 高淳文化 SCP001	2.53	180D	1.50	AA	—
24 北京国资 SCP001	2.02	182D	20.00	AAA	—
24 国网租赁 SCP004	2.12	184D	10.00	AAA	—
24 常熟城投 CP001	2.38	209D	10.00	AA+	—
24 义乌国资 SCP001	2.37	239D	13.50	AAA	—
24 张江集 SCP001	2.05	240D	10.00	AAA	—
24 泰州城建 SCP007	2.35	240D	5.50	AAA	—
24 新水国资 SCP002	2.22	240D	6.00	AA+	—
24 云天化 SCP001(科创票据)	2.58	242D	5.00	AA+	—
24 吴中国太 SCP003	2.40	252D	2.00	AA+	—
24 镇江交通 SCP002	2.47	252D	1.00	AA+	—
24 永业 SCP001	2.39	253D	5.00	AAA	—
24 吴中国太 SCP004	2.39	265D	2.50	AA+	—
24 万华化学 SCP001(科创票据)	2.11	267D	15.00	AAA	—
24 杭金投 SCP003	2.09	267D	10.00	AAA	—
24 悦达 SCP004	2.60	267D	5.00	AAA	—
24 嘉兴经投 SCP001	2.49	267D	2.30	AA	—
24 济南城建 SCP003	2.10	268D	10.00	AAA	—
24 物产中大 SCP002	2.18	269D	20.00	AAA	—
24 鲁金 SCP002(科创票据)	2.06	269D	10.00	AAA	—
24 昆山创业 SCP002	2.35	269D	7.00	AAA	—
24 国网租赁 SCP005	2.14	269D	5.00	AAA	—
24 华为 SCP001	2.12	270D	30.00	AAA	—
24 甘公投 SCP002	2.45	270D	10.00	AAA	—

24 福清核电 SCP001	2.27	270D	10.00	AAA	—
24 汉江国资 SCP001	2.39	270D	10.00	AAA	—
24 甘公投 SCP001	2.53	270D	10.00	AAA	—
24 宁河西 SCP003	2.07	270D	8.00	AAA	—
24 昆山创业 SCP003	2.35	270D	6.00	AAA	—
24 泰州城建 SCP008	2.35	270D	3.00	AAA	—
24 赣州城投 SCP001	2.45	270D	10.00	AA+	—
24 昆明安居 SCP002	2.88	270D	8.00	AA+	—
24 榆林城投 SCP002	2.44	270D	6.00	AA+	—
24 珠海九洲 SCP001	2.50	270D	5.00	AA+	—
24 鑫城集团 SCP001	2.40	270D	5.00	AA+	—
24 桐昆 SCP002(科创票据)	2.39	270D	5.00	AA+	—
24 金鼎产融 SCP002	3.00	270D	5.00	AA+	—
24 青岛军民 SCP001	2.54	270D	5.00	AA+	—
24 北辰科技 SCP002	2.55	270D	5.00	AA+	—
24 嘉公路 SCP001	2.40	270D	5.00	AA+	—
24 海安开投 SCP002	2.50	270D	5.00	AA+	—
24 鑫泰 SCP002	2.50	270D	4.30	AA+	—
24 创元投资 SCP001	2.23	270D	4.00	AA+	—
24 连云金控 SCP001	2.52	270D	4.00	AA+	—
24 珠海港 SCP003	2.26	270D	4.00	AA+	—
24 泰交通 SCP002	2.43	270D	3.30	AA+	—
24 江宁科学 SCP001	2.36	270D	3.00	AA+	—
24 宁夏农垦 SCP002	2.52	270D	3.00	AA+	—
24 陕文投 SCP001	3.20	270D	2.00	AA+	—
24 高淳建设 SCP002	2.48	270D	5.00	AA	—
24 高淳经开 SCP003	2.53	270D	4.00	AA	—
24 九龙园 SCP001	2.63	270D	3.00	AA	—
24 温州国投 SCP001	2.50	270D	2.00	AA	—
24 靖江城投 SCP001	2.52	270D	1.70	AA	—
24 广西林业 SCP001	3.50	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
24 湘高速 CP001	2.18	366D	20.00	AAA	—
24 鄂长投 CP001	2.39	366D	10.00	AAA	—
24 鄂文旅 CP001	2.35	366D	10.00	AAA	—
24 平安租赁 CP001	2.58	366D	8.00	AAA	—
24 包钢集 CP001	3.00	366D	6.00	AAA	—
24 苏州资产 CP001	2.38	366D	5.00	AAA	—
24 南宁城投 CP002	2.44	365D	3.95	AAA	A-1
24 株洲城建 CP001	2.49	366D	14.00	AA+	—
24 连云城建 CP001	2.40	365D	6.00	AA+	—

24 克拉玛依 CP001	2.45	365D	5.00	AA+	—
24 新疆金投 CP001	2.52	366D	5.00	AA+	—
24 徐高新集 CP001	2.49	365D	4.90	AA+	—
24 武清经开 CP001	2.70	366D	14.00	AA	—
24 淮安高新 CP001	2.57	366D	4.38	AA	—
24 吴中交投 CP001	2.54	366D	2.08	AA	—
24 伊宁国资 CP001	2.70	366D	1.20	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 六安城投 MTN002	2.45	1.04	4.00	AA+	—
24 云投 MTN003	2.86	1.50	10.00	AAA	—
24 云南水利 MTN001	2.78	1.50	8.00	AA+	—
24 象屿股份 MTN001	3.03	2.00	15.00	AAA	AAA
24 云投 MTN004	2.98	2.00	10.00	AAA	—
24 水发集团 MTN002	2.98	2.00	10.00	AAA	—
24 中建六局 MTN001 (科创票据)	2.60	2.00	8.00	AAA	—
24 财通租赁 MTN002 (绿色)	2.70	2.00	1.00	AAA	—
24 冀能股份 MTN001A	2.88	2.00	7.00	AA+	AA+
24 武清经开 MTN003	2.94	2.00	5.00	AA	—
24 武清经开 MTN004	3.03	2.00	2.10	AA	—
24 津城建 MTN010	2.99	3.00	20.00	AAA	—
24 陕有色 MTN001	2.80	3.00	20.00	AAA	AAA
24 华侨城 MTN002	3.32	3.00	20.00	AAA	AAA
24 大兴发展 MTN001	2.55	3.00	15.40	AAA	—
24 晋能装备 MTN002	2.90	3.00	15.00	AAA	—
24 江宁经开 MTN001	2.70	3.00	15.00	AAA	—
24 大唐发电 MTN002	2.59	3.00	15.00	AAA	AAA
24 厦国贸控 MTN002	2.80	3.00	15.00	AAA	—
24 云建投 MTN004	3.20	3.00	10.00	AAA	—
24 首钢 MTN001A	2.58	3.00	10.00	AAA	AAA
24 中航租赁 MTN002	2.70	3.00	10.00	AAA	AAA
24 华阳新材 MTN004	2.80	3.00	10.00	AAA	—
24 百联集 MTN001	2.74	3.00	10.00	AAA	AAA
24 晋能装备 MTN001	2.92	3.00	10.00	AAA	—
24 苏州高新 MTN001	2.64	3.00	10.00	AAA	—
24 江北建投 MTN003	2.67	3.00	7.00	AAA	—
24 滨建投 MTN004	2.97	3.00	5.00	AAA	AAA
24 中原资产 MTN002	3.00	3.00	5.00	AAA	—
24 兆润投资 MTN001	2.60	3.00	5.00	AAA	—
24 武商贸集 MTN001	2.65	3.00	4.00	AAA	—
24 福州左海 MTN002	2.60	3.00	2.00	AAA	—
24 芜湖建设 MTN001	2.74	3.00	0.68	AAA	—

24 巨化 MTN001(可持续挂钩)	2.70	3.00	15.00	AA+	—
24 先行控股 MTN002	2.66	3.00	11.36	AA+	—
24 晋能山西 MTN002	3.43	3.00	10.00	AA+	—
24 永川高新 MTN001	2.98	3.00	10.00	AA+	AA+
24 黑牡丹 MTN002	2.89	3.00	10.00	AA+	—
24 淮安新城 MTN001	2.79	3.00	8.00	AA+	—
24 瀚瑞投资 MTN002	2.90	3.00	6.00	AA+	—
24 瀚瑞投资 MTN001	3.00	3.00	6.00	AA+	—
24 陕西旅游 MTN002	3.70	3.00	6.00	AA+	—
24 创鸿资产 MTN001	2.90	3.00	5.10	AA+	—
24 冀能股份 MTN001B	3.15	3.00	5.00	AA+	AA+
24 靖江港 MTN001	2.99	3.00	5.00	AA+	—
24 无锡山水 MTN001	2.75	3.00	4.00	AA+	—
24 南京浦口 MTN003	2.75	3.00	4.00	AA+	—
24 通汇投资 MTN001	2.95	3.00	2.90	AA+	AA+
24 淮安新城 MTN002	2.86	3.00	2.10	AA+	—
24 启东城投 MTN001	2.73	3.00	2.04	AA+	—
24 乌交旅 MTN002	3.06	3.00	2.00	AA+	—
24 如皋经贸 MTN001	2.78	3.00	2.00	AA+	—
24 徐州经开 MTN004	2.70	3.00	2.00	AA+	—
24 宜兴环保 MTN001	2.80	3.00	8.50	AA	—
24 溧水经开 MTN001	2.85	3.00	8.50	AA	—
24 六合新城 MTN001	2.80	3.00	8.00	AA	—
24 金华融盛 MTN001	2.80	3.00	7.36	AA	—
24 阜阳交投 MTN001	2.89	3.00	5.21	AA	—
24 新盛投资 MTN001	2.95	3.00	5.10	AA	—
24 荆门高新 MTN001	3.14	3.00	5.00	AA	—
24 苏通 MTN001	2.82	3.00	4.00	AA	—
24 南川城投 MTN002	3.00	3.00	3.10	AA	—
24 金合盛 MTN001	2.75	3.00	2.00	AA	—
24 龙岩投资 MTN002	2.98	3.00	2.00	AA	—
24 南电 MTN001	2.32	3.00	30.00	AAA	—
24 津城建 MTN009	3.10	3.50	6.00	AAA	AAA
24 晋能煤业 MTN005	2.90	5.00	30.00	AAA	—
24 南电 MTN002	2.53	5.00	30.00	AAA	—
24 吉林高速 MTN001	2.77	5.00	20.00	AAA	AAA
24 首钢 MTN001B	2.75	5.00	20.00	AAA	AAA
24 中建投资 MTN001	2.84	5.00	20.00	AAA	AAA
24 中节能 GN001	2.72	5.00	15.00	AAA	AAA
24 青岛城投 MTN002	2.85	5.00	15.00	AAA	—
24 川能投 MTN003	2.99	5.00	15.00	AAA	AAA
24 开滦 MTN001(科创票据)	2.98	5.00	15.00	AAA	—

24 铁建房产 MTN001	3.00	5.00	15.00	AAA	—
24 渝两江 MTN001A	2.74	5.00	11.02	AAA	—
24 义乌国资 MTN001	2.83	5.00	7.00	AAA	AAA
24 扬城建 MTN003	2.74	5.00	6.00	AAA	—
24 国联 MTN002	2.76	5.00	5.00	AAA	—
24 威海城投 MTN001A	2.95	5.00	14.70	AA+	—
24 皖新华 MTN001	2.80	5.00	10.00	AA+	—
24 万州经开 MTN003	3.25	5.00	8.00	AA+	—
24 株洲高科 MTN003	3.65	5.00	8.00	AA+	—
24 镇江城建 MTN001	2.80	5.00	5.60	AA+	—
24 南部新城 MTN001	3.30	5.00	5.21	AA+	—
24 莫干山 MTN002	2.70	5.00	5.00	AA+	—
24 嘉兴科技 MTN001	2.67	5.00	5.00	AA+	—
24 淮北建投 MTN004	3.20	5.00	5.00	AA+	—
24 威海城投 MTN001B	3.28	5.00	4.00	AA+	—
24 鹰潭国控 MTN001	2.95	5.00	3.26	AA+	—
24 许昌建投 MTN001	3.05	5.00	5.00	AA	—
24 合建投 MTN002	2.73	7.00	20.00	AAA	—
24 皖交控 MTN002	2.73	7.00	10.00	AAA	—
24 陕煤化 MTN002	3.30	10.00	25.00	AAA	AAA
24 中车集 MTN001	2.70	10.00	20.00	AAA	AAA
24 华润 MTN001	2.72	10.00	20.00	AAA	AAA
24 诚通控股 MTN006A	3.00	10.00	20.00	AAA	AAA
24 大横琴 MTN003	3.29	10.00	15.00	AAA	AAA
24 深圳地铁 MTN002	2.82	10.00	15.00	AAA	AAA
24 蜀道投资 MTN003	2.93	10.00	15.00	AAA	AAA
24 冀交投 MTN002	2.98	10.00	11.00	AAA	AAA
24 渝两江 MTN001B	2.95	10.00	10.00	AAA	—
24 中冶 MTN002	2.92	10.00	10.00	AAA	AAA
24 诚通控股 MTN006B	3.13	15.00	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，收益率震荡下行。AAA 级短期融资券中，1 个月品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.24%；6 个月品种收益率较前周下行 6BP，上周收于 2.38%；1 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.54%。
- 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 2.60%；5 年期品种收益率与前周持平，上周收于 2.82%。
- 企业债方面，收益率震荡下行。AAA 级企业债中，3 年期品种收益率较前周下行 7BP，上周收于 2.47%；5 年期品种收益率较前周下行 6BP，上周收于 2.63%；10 年期品种收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.74%。

◆ 外币利率市场上周概览——二级市场

- 美国国债价格上涨，10 年期美国国债收益率较前周下行 6.8BP，上周收于 4.180%。
- 德国国债价格下跌，10 年期德国国债收益率较前周上行 5.1BP，上周收于 2.414%。

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	4.531	-15.9	-8.8	28.1
5 年	4.157	-12.3	-8.8	31.0
10 年	4.180	-6.8	-7.0	30.1
30 年	4.328	-4.2	-5.1	30.0
德国国债				
2 年	2.890	3.7	-1.1	48.6
5 年	2.428	5.5	-0.3	48.0
10 年	2.414	5.1	0.3	39.0
30 年	2.550	5.7	1.1	28.7

数据来源：彭博

◆ 外币利率市场上周概览——利率掉期市场

- 美元利率掉期率震荡下行，10 年期美元利率掉期率较前周下行 6.92BP，上周收于 3.8064%。

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	4.4501	-10.88	-7.04	38.44
10 年	3.8064	-6.92	-6.69	33.24
30 年	3.5935	-5.59	-5.66	27.74

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周上涨 2.34%，上周最高 2088.19 美元/盎司、最低 2024.32 美元/盎司，收于 2083.39 美元/盎司。
- 白银价格较前周上涨 0.92%，上周最高 23.27 美元/盎司、最低 22.25 美元/盎司，收于 23.15 美元/盎司。
- 铂金价格较前周下跌 1.76%，上周最高 900.85 美元/盎司、最低 865.21 美元/盎司，收于 884.67 美元/盎司。
- 钯金价格较前周下跌 1.61%，上周最高 974.25 美元/盎司、最低 906.84 美元/盎司，收于 955.57 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	2083.39	2.34%	1.97%
白银	23.15	0.92%	2.12%
铂金	884.67	-1.76%	1.01%
钯金	955.57	-1.61%	1.44%

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 4.23%，上周最高 80.85 美元/桶、最低 75.84 美元/桶，收于 79.81 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 3.36%，上周最高 84.34 美元/桶、最低 80.19 美元/桶，收于 83.46 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	79.81	4.23%	1.93%
ICE Brent 主力合约	83.46	3.36%	1.76%

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 0.43%，上周最高 8559.00 美元/吨、最低 8449.00 美元/吨，收于 8522.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周上涨 2.38%，上周最高 2236.00 美元/吨、最低 2182.00 美元/吨，收于 2236.00 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	8522.00	-0.43%	0.51%
LME 3 月铝	2236.00	2.38%	0.49%

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 0.55%，上周最高 1161.50 美分/蒲式耳、最低 1128.50 美分/蒲式耳，收于 1149.75 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)	559.00	-1.84%	-3.04%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1149.75	0.55%	0.90%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	424.25	2.54%	0.12%
ICE 棉花(美分/磅)	95.57	2.36%	-3.96%
ICE 白糖(美分/磅)	21.00	-3.63%	-2.51%

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上涨 8.96%，上周最高 1.918 美元/百万英热单位、最低 1.710 美元/百万英热单位，收于 1.836 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	1.836	8.96%	-0.65%

数据来源：路透