

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	10
贵金属市场上周概览	18
原油市场上周概览	19
基本金属市场上周概览	20
农产品市场上周概览	21
天然气市场上周概览	22

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7.1004，较前周贬值约0.04%；银行间市场人民币汇率较前周贬值约0.44%，上周收于7.2283；1年期掉期点较前周上行19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535个点，上周收于7.0445。
- **外币汇率市场上周概览**
 - ✓ 美元指数较前周上涨0.55%，上周收于104.004。
 - ✓ 欧元兑美元较前周下跌0.75%，上周收于1.0805。
 - ✓ 美元兑日元较前周上涨1.61%，上周收于151.42。
 - ✓ 澳元兑美元较前周下跌0.70%，上周收于0.6514。
- **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1.77%和1.92%，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1.85%和2.05%。
 - ✓ 二级市场：10年期国债收益率较前周下行1BP，上周收于2.40%；5年期国开债收益率较前周下行4BP，上周收于2.29%。
 - ✓ 一级市场：财政部招标发行91天期贴现国债，以及1年、5年、7年和50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、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：共发行超短期融资券124支，规模合计977.31亿元；短期融资券13支，规模合计116.90亿元；中期票据176支，规模合计1555.06亿元。
 - ✓ 二级市场：短期融资券收益率小幅震荡，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10.8BP，上周收于4.198%。
 - ✓ 德国国债价格上涨，10年期德国国债收益率较前周下行11.9BP，上周收于2.323%。
- **贵金属市场上周概览**
 - ✓ 黄金价格较前周上涨0.40%，上周收于2164.15美元/盎司。
 - ✓ 白银价格较前周下跌1.97%，上周收于24.66美元/盎司。
 - ✓ 铂金价格较前周下跌4.21%，上周收于894.04美元/盎司。
 - ✓ 钯金价格较前周下跌8.52%，上周收于985.84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0.34%，上周收于80.82美元/桶。
 - ✓ Brent原油期货主力合约价格较前周上涨0.20%，上周收于84.94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8847.00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0.54%，上周收于1192.00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上涨0.39%，上周收于1.809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22日）报 7.1004，较前周贬值约 0.04%。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 7.1920、最低 7.2304，收于 7.2283，波幅为 0.53%。
- 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 19 个点，上周最高-2633、最低-2670，收于-2640，波幅为 1.40%。
- 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 535 个点，上周最高 7.0640、最低 6.9796，17:00 收于 7.0445，波幅为 1.20%。

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	—	—	7.1004	29	-32	177
银行间市场汇价	7.2304	7.1920	7.2283	318	353	1363
掉期点						
1 个月期限	-219	-237.5	-219	2	21	-11
2 个月期限	-438	-461.5	-448	-6	-5	-25
3 个月期限	0	-684	-660	7	-10	-25
6 个月期限	-1325.5	-1364.65	-1336	4	-8	-88
1 年期限	-2633	-2670	-2640	19	23	-225

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	7.1642	7.0705	7.1385	435	650	-679
2 个月期限	7.1585	7.0719	7.1385	480	760	-450
3 个月期限	7.1655	7.0741	7.1335	480	845	-288
6 个月期限	7.1286	7.0426	7.1007	427	892	60
1 年期限	7.0640	6.9796	7.0445	535	960	802

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 0.55%，上周最高 104.496、最低 103.172，收于 104.004。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.75%，上周最高 1.0942、最低 1.0800，收于 1.0805。
- 美元兑日元较前周上涨 1.61%，上周最高 151.86、最低 148.88，收于 151.42。
- 澳元兑美元较前周下跌 0.70%，上周最高 0.6634、最低 0.6502，收于 0.6514。

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	104.004	0.55%	-0.15%
欧元/美元	1.0805	-0.75%	0.02%
美元/日元	151.42	1.61%	0.96%
澳元/美元	0.6514	-0.70%	0.29%

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 1.77%和 1.92%，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 1.85%和 2.05%。央行公开市场方面，上周一（3 月 18 日）进行逆回购操作 100 亿元，逆回购到期 100 亿元；上周二（3 月 19 日）进行逆回购操作 50 亿元，逆回购到期 100 亿元；上周三（3 月 20 日）进行逆回购操作 30 亿元，逆回购到期 30 亿元；上周四（3 月 21 日）进行逆回购操作 20 亿元，逆回购到期 30 亿元；上周五进行逆回购操作 20 亿元，逆回购到期 130 亿元。本周（3 月 25 日-3 月 29 日）将有逆回购到期 220 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)	1.77	1	13
7 天 Shibor (1W)	1.85	-5	7
3 月期 Shibor (3M)	2.16	0	-3
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.92	4	18
7 天回购定盘利率 (FR007)	2.05	5	0

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，收益率震荡下行。1 年期国债收益率较前周下行 7BP，上周收于 1.76%；5 年期国债收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.23%；10 年期国债收益率较前周下行 1BP，上周收于 2.40%。
- 政策性金融债方面，收益率小幅震荡。1 年期国开债收益率较前周上行 1BP，上周收于 1.91%；5 年期国开债收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.29%；10 年期国开债收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.44%。

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	1.76	-7	-2
3 年期	2.08	-6	-3
5 年期	2.23	-4	1
7 年期	2.34	-2	-2
10 年期	2.40	-1	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	1.91	1	8
3 年期	2.20	-5	2
5 年期	2.29	-4	2
7 年期	2.45	-1	3
10 年期	2.44	-2	-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，上周三财政部发行 1 年和 5 年期付息国债；上周五财政部发行 91 天期贴现国债，以及 7 年和 50 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 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、3 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浮动-1BP 至 1BP；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浮动-2BP 至 1BP；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	1	6
6 月期	2.03	1	6
9 月期	1.99	1	6
1 年期	1.98	1	5
3 年期	2.03	1	3
4 年期	2.10	1	3
5 年期	2.16	0	1
7 年期	2.28	-1	0
10 年期	2.43	-1	0
3 月 Shibor（ACT/360）			
6 月期	2.17	1	1
9 月期	2.16	1	5
1 年期	2.18	1	5
2 年期	2.18	0	4
3 年期	2.22	0	1
4 年期	2.28	-2	-1
5 年期	2.36	-1	-1
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 124 支，规模合计 977.31 亿元；短期融资券 13 支，规模合计 116.90 亿元；中期票据 176 支，规模合计 1555.06 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限波动-2BP 至 2BP。

表 8：一级市场信用债发行情况

超短期融资券	票面利率 (%)	发行期限	发行规模 (亿)	主体评 级	债券评 级
24 陕延油 SCP003	2.03	30D	30.00	AAA	—
24 国网租赁 SCP008	2.05	40D	10.00	AAA	—
24 中建八局 SCP006	2.06	57D	20.00	AAA	—
24 国网租赁 SCP009	2.03	65D	5.00	AAA	—
24 夏商 SCP006	2.21	70D	5.00	AA+	—
24 江苏广电 SCP004(科创票据)	2.08	87D	5.00	AAA	—
24 首旅 SCP004	2.08	88D	12.00	AAA	—
24 首旅 SCP003	2.08	88D	12.00	AAA	—
24 万华化学 SCP004(科创票据)	2.07	90D	30.00	AAA	—
24 万华化学 SCP003(科创票据)	2.07	90D	10.00	AAA	—
24 浙能源 SCP001	1.96	90D	10.00	AAA	—
24 洪市政 SCP002	2.09	90D	5.00	AAA	—
24 中拓 SCP005	2.27	93D	4.50	AA+	—
24 苏州高新 SCP014	2.17	95D	2.00	AAA	—
24 南通城建 SCP002	2.09	100D	10.00	AAA	—
24 厦国贸 SCP006	2.16	113D	15.00	AAA	—
24 建发 SCP003	2.24	119D	10.00	AAA	—
24 赣国资 SCP002	2.08	120D	23.00	AAA	—
24 华电资本 SCP003	2.09	120D	5.00	AAA	—
24 凯盛科技 SCP003	2.16	120D	5.00	AAA	—
24 台州国资 SCP002	2.28	120D	3.00	AAA	—
24 航天电子 SCP003	2.20	120D	5.00	AA+	—
24 江宁城建 SCP003	2.36	120D	5.00	AA+	—
24 苏州高新 SCP015	2.16	122D	3.00	AAA	—
24 苏州高新 SCP016	2.15	128D	2.00	AAA	—
24 沪机场股 SCP003	2.01	149D	10.00	AAA	—
24 沪机场股 SCP004	2.01	149D	10.00	AAA	—
24 豫园商城 SCP002	4.85	150D	8.60	AAA	—
24 淮安文旅 CP002	2.50	150D	2.00	AA+	—
24 一汽租赁 SCP004	2.27	159D	12.00	AAA	—

24 首钢股份 SCP001	2.12	161D	10.00	AAA	—
24 青岛国信 SCP001	2.33	172D	5.00	AAA	—
24 华润置地 SCP003	2.38	175D	10.00	AAA	—
24 华润置地 SCP002	2.38	175D	10.00	AAA	—
24 华润置地 SCP001	2.38	175D	10.00	AAA	—
24 物产中大 SCP003	2.10	177D	20.00	AAA	—
24 鲁高速股 SCP001	2.08	177D	10.00	AAA	—
24 远东租赁 SCP005	2.54	177D	10.00	AAA	—
24 中燃投资 SCP001	2.22	177D	8.00	AAA	—
24 中交一公 SCP003(科创票据)	2.09	178D	20.00	AAA	—
24 河南发电 SCP001	2.23	178D	5.00	AAA	—
24 中集租赁 SCP002	2.56	178D	5.00	AA+	—
24 浙交投 SCP006	2.05	179D	30.00	AAA	—
24 杭商贸 SCP003	2.12	179D	10.00	AAA	—
24 建发 SCP001	2.26	179D	10.00	AAA	—
24 巨石 SCP003	2.15	179D	4.00	AAA	—
24 越秀集团 SCP001	2.18	180D	15.00	AAA	—
24 苏沙钢 SCP001(科创票据)	2.40	180D	7.00	AAA	—
24 龙盛 SCP006(科创票据)	2.32	180D	4.00	AAA	—
24 福州国资 SCP001	2.30	180D	2.50	AAA	A-1
24 苏州交投 SCP001	2.09	180D	2.00	AAA	—
24 杭州热联 SCP004	2.30	180D	10.00	AA+	—
24 五矿发展 SCP001	2.45	180D	5.00	AA+	—
24 新海连 SCP001	2.45	180D	5.00	AA+	—
24 武清经开 CP002	2.80	180D	5.00	AA	—
24 金合盛 SCP001	2.68	180D	4.00	AA	—
24 宁国建投 SCP001	2.58	180D	2.35	AA	—
24 浦口交通 SCP001	2.47	180D	2.00	AA	—
24 三峡租赁 SCP001	2.15	210D	10.00	AAA	—
24 中建七局 SCP002(科创票据)	2.12	210D	10.00	AAA	—
24 建发 SCP002	2.26	210D	10.00	AAA	—
24 深圳水务 SCP001	2.25	210D	8.00	AAA	—
24 江苏港口 SCP002	2.20	210D	4.00	AAA	—
24 川水电 SCP002	2.42	210D	10.00	AA+	—
24 吴中灵天 SCP001	2.44	210D	5.00	AA+	—
24 百业源 SCP001	2.50	210D	4.00	AA+	—
24 金陵饭店 SCP001	2.18	219D	2.65	AA+	—
24 国网租赁 SCP006	2.36	224D	5.00	AAA	—
24 国网租赁 SCP007	2.36	224D	5.00	AAA	—
24 豫水利 SCP001	2.20	240D	13.00	AAA	—
24 川高速 SCP002	2.16	240D	5.00	AAA	—
24 中方财团 SCP001	2.22	240D	2.00	AAA	—

24 惠山国投 SCP002	2.40	240D	2.90	AA+	—
24 镇江交通 SCP005	2.47	245D	3.00	AA+	—
24 南海控股 SCP001	2.18	250D	6.00	AAA	—
24 瀚瑞投资 SCP002	2.48	250D	4.00	AA+	—
24 招商租赁 SCP005	2.13	255D	5.00	AAA	—
24 京电子城 SCP002	2.60	265D	4.00	AA	—
24 红狮 SCP001	2.55	268D	5.00	AAA	—
24 横店 CP001	2.54	269D	10.00	AA+	—
24 桐昆 SCP004(科创票据)	2.48	269D	5.00	AA+	—
24 宝钢 SCP002	2.12	270D	30.00	AAA	—
24 宝钢 SCP001	2.12	270D	20.00	AAA	—
24 陕西建工 SCP004	2.97	270D	15.00	AAA	—
24 淮南矿 SCP004	2.41	270D	15.00	AAA	—
24 沪风电 SCP001	2.27	270D	15.00	AAA	—
24 深燃气 CP001	2.18	270D	15.00	AAA	—
24 深燃气 SCP003	2.09	270D	10.00	AAA	—
24 津保投 SCP006	2.50	270D	10.00	AAA	—
24 杭州国资 SCP003	2.14	270D	10.00	AAA	—
24 津保投 SCP007	2.50	270D	10.00	AAA	—
24 中文天地 SCP003	2.14	270D	10.00	AAA	—
24 鄂长投 SCP001	2.30	270D	10.00	AAA	—
24 云南白药 SCP001(科创票据)	2.30	270D	10.00	AAA	—
24 陕建集团 SCP003(科创票据)	2.89	270D	10.00	AAA	—
24 合建投 SCP001	2.23	270D	9.00	AAA	—
24 厦路桥 SCP001	2.20	270D	6.00	AAA	—
24 津保投 SCP005	2.57	270D	6.00	AAA	—
24 常州投资 SCP001	2.22	270D	5.00	AAA	—
24 华数 SCP001	2.20	270D	5.00	AAA	—
24 泉州交通 SCP003	2.38	270D	5.00	AAA	—
24 深圳港集 SCP001	2.18	270D	5.00	AAA	—
24 常城建 SCP003	2.19	270D	3.80	AAA	—
24 津地铁 SCP002	2.45	270D	3.00	AAA	—
24 常德经建 SCP001	2.47	270D	10.00	AA+	—
24 浙兴合 SCP001	2.49	270D	5.00	AA+	—
24 鲁商 SCP005	3.49	270D	5.00	AA+	—
24 新海连 SCP002	2.48	270D	4.10	AA+	—
24 舟山旅游 SCP001	2.44	270D	3.90	AA+	—
24 瀚瑞投资 SCP001	2.50	270D	3.50	AA+	—
24 瘦西湖 SCP002	2.43	270D	3.09	AA+	—
24 吴中经发 SCP005	2.41	270D	3.00	AA+	—
24 东阳光 SCP002	6.50	270D	2.70	AA+	—
24 石交投 SCP001	2.52	270D	5.00	AA	—

24 怀化高新 SCP001	2.88	270D	4.92	AA	—
24 宿迁新城 SCP003	2.50	270D	3.30	AA	—
24 温州国投 SCP002	2.43	270D	3.00	AA	—
24 张保实业 SCP002	2.48	270D	3.00	AA	—
24 福建机电 SCP001	2.75	270D	2.50	AA	—
24 南宁高新 SCP002	2.68	270D	2.00	AA	—
24 石狮产业 SCP003	2.54	270D	2.00	AA	—
24 宁波建工 SCP001	2.54	270D	2.00	AA	—
24 石狮产业 SCP002	2.54	270D	2.00	AA	—
24 石狮产业 SCP004	2.52	270D	1.00	AA	—
短期融资券	票面利率 (%)	发行期限	发行规模 (亿)	主体评 级	债券评 级
24 恒力 CP001 (科创票据)	3.34	365D	5.00	AAA	—
24 抚州投资 CP001	2.50	365D	8.50	AA+	—
24 淮安文旅 CP001	2.58	365D	8.00	AA+	—
24 新疆能源 CP001	2.47	365D	5.00	AA+	—
24 方洋 CP001	2.53	365D	5.00	AA+	—
24 今世缘 CP001	2.50	365D	3.40	AA+	—
24 陕西旅游 CP001	2.89	365D	3.00	AA+	—
24 溧水经开 CP001	2.50	365D	7.00	AA	—
24 浦口交通 CP001	2.42	365D	7.00	AA	—
24 威经开 CP001	2.97	365D	3.00	AA	—
24 太仓港 CP002	2.55	365D	2.00	AA	—
24 南电 CP002	2.02	365D	30.00	A+	—
24 南电 CP001	2.02	365D	30.00	A+	—
中期票据	票面利率 (%)	发行期限 (年)	发行规模 (亿)	主体评 级	债券评 级
24 昆明产投 MTN002	3.78	1.75	10.00	AA+	—
24 太仓港 MTN001	2.72	1.99	3.50	AA	—
24 平安租赁 MTN002	3.01	2.00	25.00	AAA	—
24 北部湾 MTN005	3.20	2.00	10.00	AAA	AAA
24 特变股份 MTN001A	3.08	2.00	8.00	AAA	—
24 冀中能源 MTN005 (科创票据)	3.50	2.00	15.00	AAA	—
24 水发集团 MTN003A	3.24	2.00	9.00	AAA	—
24 滨江房产 MTN001	3.64	2.00	7.00	AAA	—
24 青岛国信 MTN004	2.93	2.00	10.00	AAA	—
24 融和融资 MTN001	2.50	2.00	5.00	AAA	—
24 中航租赁 MTN004	2.67	2.00	5.00	AAA	—
24 鲁宏桥 MTN004	3.50	2.00	10.00	AA+	AA+
24 苏新国资 MTN006	2.56	2.00	7.00	AA+	—
24 碧水源 MTN001 (科创票据)	3.30	2.00	5.00	AA+	AA+
24 青城租赁 MTN001	3.00	2.00	5.00	AA+	—

24 镇国投 MTN001	2.70	2.00	4.00	AA+	—
24 中化股 MTN002	2.75	3.00	40.00	AAA	—
24 中核 MTN001	2.45	3.00	30.00	AAA	AAA
24 豫交投 MTN002	2.70	3.00	25.00	AAA	AAA
24 海运集装 MTN001 (科创票据)	2.78	3.00	20.00	AAA	AAA
24 赣国资 MTN002	2.56	3.00	20.00	AAA	—
24 中冶 MTN004	2.74	3.00	20.00	AAA	AAA
24 物产中大 MTN001	2.60	3.00	20.00	AAA	—
24 中冶 MTN003	2.79	3.00	20.00	AAA	AAA
24 新长宁 MTN001	2.64	3.00	16.00	AAA	—
24 首都机场 MTN001 (绿色)	2.35	3.00	15.00	AAA	—
24 河钢集 MTN004	2.90	3.00	15.00	AAA	AAA
24 湖北港口 MTN002	2.79	3.00	15.00	AAA	—
24 青岛城投 MTN003	2.74	3.00	14.00	AAA	—
24 津城建 MTN013	3.10	3.00	13.00	AAA	—
24 苏国资 MTN004	2.65	3.00	12.50	AAA	—
24 海尔金盈 MTN002	3.23	3.00	10.00	AAA	—
24 新奥天然气 GN001	2.65	3.00	10.00	AAA	AAA
24 深业 MTN002	2.75	3.00	10.00	AAA	—
24 中化股 MTN003	2.73	3.00	10.00	AAA	—
24 浙国贸 MTN001	2.70	3.00	15.00	AAA	—
24 凤凰传媒 MTN002	2.65	3.00	10.00	AAA	—
24 鲁钢铁 MTN002	2.88	3.00	10.00	AAA	—
24 陕西建工 MTN001	4.28	3.00	10.00	AAA	—
24 京汽集 MTN002	2.57	3.00	10.00	AAA	—
24 潍坊城建 MTN003A	3.31	3.00	15.00	AAA	—
24 桂投资 MTN003	3.13	3.00	10.00	AAA	—
24 葛洲海投 MTN001	2.84	3.00	10.00	AAA	AAA
24 中电投 MTN002	2.67	3.00	9.00	AAA	AAA
24 鲁信 MTN001	2.53	3.00	8.00	AAA	—
24 水发集团 MTN003B	3.80	3.00	6.00	AAA	—
24 国药租赁 MTN003	2.88	3.00	7.00	AAA	—
24 佛控 MTN001	2.74	3.00	7.00	AAA	AAA
24 贵州交通 MTN001	3.00	3.00	6.00	AAA	AAA
24 中交三航 MTN001	2.70	3.00	5.00	AAA	—
24 皖能源 MTN001 (碳中和债)	2.50	3.00	5.00	AAA	—
24 江北新区 MTN008	2.65	3.00	5.00	AAA	—
24 颐养健康 MTN001A	2.80	3.00	2.00	AAA	AAA
24 四川路桥 MTN001	2.67	3.00	5.00	AAA	—
24 融和融资 GN002 (碳中和债)	2.63	3.00	5.00	AAA	—
24 西安高新 MTN007	3.40	3.00	10.00	AAA	AAA
24 兴业资产 MTN001	2.77	3.00	5.00	AAA	—

24 特变股份 MTN001B	3.66	3.00	7.00	AAA	—
24 天津轨交 MTN002A	2.97	3.00	4.00	AAA	—
24 越秀租赁 MTN001A	2.73	3.00	4.00	AAA	—
24 津地铁 MTN003A	2.90	3.00	1.00	AAA	—
24 新创建 GN001BC	3.55	3.00	1.00	AAA	—
24 衢州国资 MTN001	2.70	3.00	10.00	AA+	—
24 酒钢 MTN001 (科创票据)	3.20	3.00	10.00	AA+	—
24 连云金控 MTN001	3.20	3.00	10.00	AA+	—
24 福建漳州 MTN001	2.97	3.00	10.00	AA+	AA+
24 西部矿业 MTN001 (可持续挂钩)	3.50	3.00	10.00	AA+	—
24 静安投资 MTN001	2.60	3.00	10.00	AA+	—
24 新世界 MTN001	2.70	3.00	10.00	AA+	AA+
24 湖南能源 MTN001	2.80	3.00	10.00	AA+	—
24 湘潭城乡 MTN001	2.96	3.00	9.10	AA+	—
24 武清国资 MTN001	3.18	3.00	8.00	AA+	—
24 昆山高新 MTN001	2.90	3.00	8.00	AA+	—
24 萍乡创新 MTN001	3.45	3.00	6.64	AA+	—
24 南京浦口 MTN005	2.80	3.00	6.00	AA+	—
24 浙江旅投 MTN001	2.79	3.00	5.00	AA+	—
24 云铁投 MTN002	3.58	3.00	5.00	AA+	—
24 株国投 MTN002	3.06	3.00	5.00	AA+	—
24 扬州经开 MTN001	2.78	3.00	5.00	AA+	—
24 广西旅发 MTN003	3.70	3.00	5.00	AA+	—
24 乐清国投 MTN002	2.70	3.00	5.00	AA+	—
24 农垦 MTN001	2.88	3.00	5.00	AA+	—
24 华靖资产 MTN003	2.85	3.00	5.00	AA+	—
24 崇川国资 MTN002	2.65	3.00	4.50	AA+	—
24 海城建设 MTN001	2.73	3.00	8.60	AA+	—
24 开盛集团 MTN001	2.80	3.00	4.00	AA+	AA+
24 淮安新城 MTN004	2.84	3.00	3.50	AA+	—
24 太仓城投 MTN001	2.55	3.00	6.20	AA+	—
24 淮安开发 MTN006	2.98	3.00	3.00	AA+	—
24 娄城高新 MTN002	2.70	3.00	3.00	AA+	—
24 金港 MTN001	2.97	3.00	3.00	AA+	—
24 宣城国资 MTN002	2.80	3.00	3.00	AA+	—
24 武汉国创 MTN001 (科创票据)	2.70	3.00	2.20	AA+	AAA
24 龙城国控 MTN001	2.80	3.00	2.00	AA+	—
24 太仓资产 MTN001A	2.65	3.00	4.00	AA+	—
24 淮安开发 MTN004	2.89	3.00	5.00	AA+	—
24 常熟发投 MTN001	2.74	3.00	4.10	AA+	—
24 静海城投 MTN002	3.33	3.00	1.10	AA+	—
24 苏国泰 MTN001	2.82	3.00	1.00	AA+	—

24 金融城建 GN001	2.82	3.00	12.00	AA	AAA
24 昆山文商 MTN001	2.85	3.00	10.00	AA	—
24 江北新城 MTN001	2.95	3.00	8.00	AA	—
24 湖南临港 MTN001	3.35	3.00	7.60	AA	AA
24 亳州城建 MTN001	3.01	3.00	5.00	AA	—
24 扬子江投 MTN001	3.20	3.00	5.00	AA	—
24 连云交通 MTN001	2.85	3.00	4.39	AA	—
24 瀛洲发展 MTN003	2.97	3.00	3.80	AA	—
24 靖江城投 MTN002	2.90	3.00	3.10	AA	—
24 泗洪宏源 MTN001	2.86	3.00	2.30	AA	—
24 鄂州城投 MTN002	3.00	3.00	0.59	AA	—
24 安经开 MTN001	3.37	3.00	0.50	AA	—
24 国新租赁 MTN003	2.59	4.00	10.00	AAA	AAA
24 南电 MTN004	2.47	5.00	50.00	AAA	—
24 中节能 MTN001A	2.77	5.00	20.00	AAA	AAA
24 陕西交通 MTN001B	2.92	5.00	15.00	AAA	AAA
24 广州地铁 MTN004	2.63	5.00	12.00	AAA	AAA
24 唐山实业 MTN001	2.78	5.00	12.00	AAA	—
24 陕投集团 MTN001	2.66	5.00	10.00	AAA	—
24 华发集团 MTN006	3.25	5.00	10.00	AAA	AAA
24 新矿集团 MTN002(科创票据)	2.76	5.00	10.00	AAA	AAA
24 大唐发电 MTN003	2.75	5.00	10.00	AAA	AAA
24 浙资运营 MTN002	2.68	5.00	10.00	AAA	—
24 潍坊城建 MTN003B	4.19	5.00	5.00	AAA	—
24 南昌产投 MTN001	3.05	5.00	9.00	AAA	AAA
24 高速路桥 MTN001	2.67	5.00	5.00	AAA	AAA
24 山东铁发 MTN002A	2.50	5.00	5.00	AAA	AAA
24 滨建投 MTN006	3.50	5.00	5.00	AAA	—
24 山东铁发 MTN001A	2.65	5.00	5.00	AAA	—
24 建发集 MTN002	3.15	5.00	8.00	AAA	AAA
24 颐养健康 MTN001B	3.00	5.00	8.00	AAA	AAA
24 华发集团 MTN005	2.99	5.00	5.00	AAA	AAA
24 越秀租赁 MTN001B	3.05	5.00	4.00	AAA	—
24 津地铁 MTN003B	3.30	5.00	4.00	AAA	—
24 天津轨交 MTN002B	3.30	5.00	4.00	AAA	—
24 江苏港口 MTN001	2.80	5.00	3.00	AAA	—
24 昆山国创 MTN002	2.90	5.00	14.00	AA+	—
24 重庆物流 MTN001	3.04	5.00	14.00	AA+	AA+
24 渝保税 MTN001	3.00	5.00	10.00	AA+	—
24 万州经开 MTN004	3.88	5.00	10.00	AA+	—
24 三峡平湖 MTN002	3.25	5.00	10.00	AA+	—
24 德清建设 MTN001	2.61	5.00	8.27	AA+	—

24 顺德投资 MTN001	3.50	5.00	8.00	AA+	—
24 延安城投 MTN002	4.15	5.00	7.72	AA+	—
24 淮北建投 MTN006	3.50	5.00	5.80	AA+	—
24 红谷滩 MTN001	3.40	5.00	5.60	AA+	—
24 邢台交建 MTN002	2.92	5.00	5.00	AA+	—
24 景国资 MTN002B	3.95	5.00	3.00	AA+	—
24 景国资 MTN002A	3.50	5.00	7.00	AA+	—
24 潍坊投资 MTN001	4.40	5.00	5.00	AA+	—
24 乌经开 MTN003	3.10	5.00	5.00	AA+	—
24 余姚城投 MTN002	2.85	5.00	5.00	AA+	—
24 南部新城 MTN002	3.35	5.00	4.10	AA+	—
24 青岛金水 MTN001	4.00	5.00	4.00	AA+	—
24 淮安开发 MTN005	3.11	5.00	3.50	AA+	—
24 太仓资产 MTN001B	2.97	5.00	1.10	AA+	—
24 乐清国投 MTN003	2.75	5.00	2.35	AA+	—
24 滨州财金 MTN001	3.44	5.00	3.30	AA+	—
24 新郑投资 MTN001	3.47	5.00	1.50	AA+	—
24 鑫泰 MTN002	3.07	5.00	1.20	AA+	—
24 宁乡国资 MTN001	3.15	5.00	2.90	AA	—
24 联发集 MTN002	3.04	6.00	4.50	AA+	AAA
24 深能源 MTN001	2.82	10.00	20.00	AAA	—
24 中节能 MTN001B	3.05	10.00	20.00	AAA	AAA
24 京国资 MTN003A	2.79	10.00	15.00	AAA	AAA
24 京国资 MTN002A	2.81	10.00	15.00	AAA	AAA
24 中国物流 MTN001	2.99	10.00	10.00	AAA	AAA
24 陕西交通 MTN001A	3.20	10.00	5.00	AAA	AAA
24 山东铁发 MTN002B	2.86	10.00	5.00	AAA	AAA
24 山东铁发 MTN001B	2.90	10.00	5.00	AAA	—
24 川高速 MTN004A	3.01	10.00	5.00	AAA	AAA
24 诚通控股 MTN009A	3.21	15.00	70.00	AAA	AAA
24 京国资 MTN003B	2.89	15.00	10.00	AAA	AAA
24 中国信科 MTN001	3.14	15.00	15.00	AAA	AAA
24 川高速 MTN004B	3.13	15.00	5.00	AAA	AAA
24 京国资 MTN002B	2.95	20.00	10.00	AAA	AAA
24 诚通控股 MTN009B	3.35	30.00	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，收益率小幅震荡。AAA 级短期融资券中，1 个月品种收益率较前周上行 3BP，上周收于 2.36%；6 个月品种收益率较前周上行 2BP，上周收于 2.46%；1 年期品种收益率较前周下行 1BP，上周收于 2.55%。
- 中期票据方面，收益率震荡下行。AAA 级中期票据中，3 年期品种收益率与前周持平，上周收于 2.62%；5 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.72%。
- 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 2BP，上周收于 2.52%；5 年期品种收益率较前周下行 3BP，上周收于 2.62%；10 年期品种收益率较前周下行 1BP，上周收于 2.75%。

◆ 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 10.8BP，上周收于 4.198%。
- 德国国债价格上涨，10 年期德国国债收益率较前周下行 11.9BP，上周收于 2.323%。

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	4.589	-13.9	-3.0	33.9
5 年	4.182	-14.4	-6.3	33.5
10 年	4.198	-10.8	-5.2	31.9
30 年	4.378	-5.1	-0.1	35.0
德国国债				
2 年	2.827	-11.9	-7.4	42.3
5 年	2.333	-13.5	-9.8	38.5
10 年	2.323	-11.9	-8.8	29.9
30 年	2.494	-8.6	-4.5	23.1

数据来源：彭博

◆ 外币利率市场上周概览——利率掉期市场

- 美元利率掉期率下行，10 年期美元利率掉期率较前周下行 9.15BP，上周收于 3.8365%。

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	4.4796	-14.49	-4.09	41.39
10 年	3.8365	-9.15	-3.68	36.25
30 年	3.6479	-3.23	-0.22	33.18

数据来源：彭博

◆ 贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周上涨 0.40%，上周最高 2217.79 美元/盎司、最低 2145.70 美元/盎司，收于 2164.15 美元/盎司。
- 白银价格较前周下跌 1.97%，上周最高 25.77 美元/盎司、最低 24.38 美元/盎司，收于 24.66 美元/盎司。
- 铂金价格较前周下跌 4.21%，上周最高 937.15 美元/盎司、最低 887.32 美元/盎司，收于 894.04 美元/盎司。
- 钯金价格较前周下跌 8.52%，上周最高 1081.93 美元/盎司、最低 971.00 美元/盎司，收于 985.84 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	2164.15	0.40%	5.92%
白银	24.66	-1.97%	8.79%
铂金	894.04	-4.21%	2.08%
钯金	985.84	-8.52%	4.66%

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 0.34%，上周最高 83.12 美元/桶、最低 80.30 美元/桶，收于 80.82 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 0.20%，上周最高 86.92 美元/桶、最低 84.54 美元/桶，收于 84.94 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	80.82	0.34%	4.26%
ICE Brent 主力合约	84.94	0.20%	4.53%

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 9102.00 美元/吨、最低 8847.00 美元/吨，收于 8847.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周上涨 1.41%，上周最高 2309.00 美元/吨、最低 2269.00 美元/吨，收于 2309.00 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	8847.00	-2.50%	4.35%
LME 3 月铝	2309.00	1.41%	3.78%

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 0.54%，上周最高 1226.75 美分/蒲式耳、最低 1181.00 美分/蒲式耳，收于 1192.00 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)	556.25	5.05%	-3.51%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1192.00	-0.54%	4.61%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	439.50	0.34%	3.72%
ICE 棉花(美分/磅)	91.51	-2.60%	-8.04%
ICE 白糖(美分/磅)	21.86	-2.60%	-8.04%

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 0.39%，上周最高 1.900 美元/百万英热单位、最低 1.791 美元/百万英热单位，收于 1.809 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	1.809	0.39%	-9.19%

数据来源：路透