

工银市场周报 (6月17日-6月21日)

每日观察 | 周度速评 | 月度跟踪 | 季度研判 | 年度回顾

金融市场部

目录

2024年6月24日

2024年第25期 总第576期

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。

一、人民币汇率市场上周概览	1
◆人民币中间价上周五报 7.1196,较前周贬值约 0.06%;截至上周五 16:30,银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.08%,上周收于 7.2613;1 年期掉期点较前周下行 21 个点,上周收于-2930。	
◆1 年期境外美元对人民币无本金交割远期(NDF)较前周上行 157 个点,上周收于 7.0637。	
二、外币汇率市场上周概览	2
◆美元指数较前周上涨 0.23%,上周收于 105.796。	
◆欧元兑美元较前周下跌 0.08%,上周收于 1.0691。	
◆美元兑日元较前周上涨 1.54%,上周收于 159.79。	
◆澳元兑美元较前周上涨 0.38%,上周收于 0.6639。	
三、人民币利率市场上周概览	2
◆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 1.96%和 2.05%,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 1.94%和 2.03%。	
◆二级市场:10 年期国债收益率与前周持平,上周收于 2.28%;5 年期国开债收益率较前周下行 2BP,上周收于 2.07%。	
◆一级市场:财政部招标发行 91 天期贴现国债、以及 20 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、2 年、3 年、5 年和 10 年期固息债。	
四、人民币信用债市场上周概览	6
◆一级市场:发行超短期融资券 81 支,规模合计 602.02 亿元;短期融资券 15 支,规模合计 185.40 亿元;中期票据 143 支,规模合计 1237.71 亿元。	
◆二级市场:短期融资券收益率震荡上行,中期票据、企业债收益率均震荡下行。	
五、外币利率市场上周概览	13
◆美国国债价格下跌,10 年期美国国债收益率较前周上行 3.4BP,上周收于 4.255%。	
◆德国国债价格下跌,10 年期德国国债收益率较前周上行 5.2BP,上周收于 2.412%。	
六、贵金属市场上周概览	14
◆黄金价格较前周下跌 0.52%,上周收于 2320.35 美元/盎司。	
◆白银价格较前周下跌 0.07%,上周收于 29.52 美元/盎司。	
◆铂金价格较前周上涨 3.62%,上周收于 992.45 美元/盎司。	
◆钯金价格较前周上涨 6.56%,上周收于 948.68 美元/盎司。	
七、原油市场上周概览	14
◆WTI 原油期货主力合约价格较前周上涨 3.23%,上周收于 80.59 美元/桶。	
◆BRENT 原油期货主力合约价格较前周上涨 2.53%,上周收于 84.18 美元/桶。	
八、基本金属市场上周概览	15
◆LME3 月期铜价格较前周下跌 0.95%,上周收于 9680.00 美元/吨。	
九、农产品市场上周概览	15
◆CBOT 大豆期货主力合约价格较前周下跌 2.44%,上周收于 1121.00 美分/蒲式耳。	
十、天然气市场上周概览	15
◆NYMEX 天然气期货主力合约价格较前周下跌 3.98%,上周收于 2.848 美元/百万英热单位。	

一、人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周五（6月21日）报 7.1196，较前周贬值约 0.06%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.08%，上周最高 7.2535、最低 7.2618，收于 7.2613，波幅为 0.11%。
- 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 21 个点，上周最高-2882、最低-2962，收于 -2930，波幅为 2.73%。
- 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 157 个点，上周最高 7.0679、最低 7.0298，收于 7.0637，波幅为 0.54%。

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	—	—	7.1196	45	108	369
银行间市场汇价	7.2618	7.2535	7.2613	56	173	1693
掉期点						
1 个月期限	-229	-260	-232	2	-4	-24
2 个月期限	-428	-500	-486	-3	-19	-63
3 个月期限	-568	-748	-728	-1	-25	-93
6 个月期限	-1450	-1505	-1484	-13	-41	-236
1 年期限	-2882	-2962	-2930	-21	-24	-515

数据来源：Refinitiv

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	较去年末	与境内价
--	-----	-----	-----	-----	------	------

				(点)	(点)	差(点)
1 个月期限	7.1299	7.0946	7.1227	106	492	-1154
2 个月期限	7.1282	7.1005	7.1237	141	612	-890
3 个月期限	7.1258	7.0975	7.1212	148	722	-673
6 个月期限	7.1192	7.0785	7.1082	160	967	-47
1 年期限	7.0679	7.0298	7.0637	157	1152	954

数据来源: Refinitiv

二、外币汇率市场上周概览

- 美元指数较前周上涨 0.23%，上周最高 105.915、最低 105.125，收于 105.796。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.08%，上周最高 1.0761、最低 1.0668，收于 1.0691。
- 美元兑日元较前周上涨 1.54%，上周最高 159.84、最低 157.14，收于 159.79。
- 澳元兑美元较前周上涨 0.38%，上周最高 0.6679、最低 0.6583，收于 0.6639。

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	105.796	0.23%	1.07%
欧元/美元	1.0691	-0.08%	-1.38%
美元/日元	159.79	1.54%	1.58%
澳元/美元	0.6639	0.38%	-0.20%

数据来源: Refinitiv

三、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 1.96% 和 2.05%，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 1.94% 和 2.03%。央行公开市场方面，上周一（6 月 17 日）进行逆回购操作 40 亿元和 MLF 操作 1820 亿元，逆回购到期 40 亿元；上周二（6 月 18 日）进行逆回购操作 860 亿元，逆回购到期 20 亿元；上周三（6 月 19 日）进行逆回购操作 2780 亿元，逆回购到期 20 亿元；上周四（6 月 20 日）进行逆回购操作 200 亿元，逆回购到期 20 亿元；上周五进行逆回购操作 100 亿元，逆回购到期 20 亿元。本周（6 月 24 日-6 月 31 日）将有逆回购到期 3980 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)	1.96	23	16
7 天 Shibor (1W)	1.94	13	9
3 月期 Shibor (3M)	1.92	-2	-3
隔夜回购定盘利率 (FR001)	2.05	24	17
7 天回购定盘利率 (FR007)	2.03	20	15

数据来源：银行间外汇交易中心

◆ 二级市场

- 国债方面，收益率震荡下行。1 年期国债收益率与前周持平，上周收于 1.59%；5 年期国债收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.03%；10 年期国债收益率与前周持平，上周收于 2.28%。
- 政策性金融债方面，收益率震荡下行。1 年期国开债收益率较前周下行 2BP，上周收于 1.78%；5 年期国开债收益率

较前周下行 2BP，上周收于 2.07%；10 年期国开债收益率与前周持平，上周收于 2.36%。

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	1.59	0	-5
3 年期	1.87	-2	-5
5 年期	2.03	-2	-4
7 年期	2.17	-3	-8
10 年期	2.28	0	-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	1.78	-2	-3
3 年期	1.96	-3	-6
5 年期	2.07	-2	-5
7 年期	2.23	-3	-7
10 年期	2.36	0	-4

数据来源：工商银行

◆ 一级市场

- 国债方面，上周三财政部招标发行 7 年和 20 年期付息国债；上周五财政部招标发行 91 天期贴现国债、20 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 5 年和 10 年期固息债；农发行招标发行 2 年和 7 年期固息债。上周三进出口行招标发行 1 年期固息债；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 年和 2 年期固息债。

◆ 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震荡区间 -3BP 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震荡下行 0BP 至 2BP；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	1.91	5	6
6 月期	1.88	4	3
9 月期	1.87	3	2
1 年期	1.86	3	1
3 年期	1.85	-3	-6
4 年期	1.95	0	-4
5 年期	2.01	0	-5
7 年期	2.09	0	-5
10 年期	2.17	0	-5
3 月 Shibor（ACT/360）			
6 月期	1.92	-1	-1
9 月期	1.97	0	0
1 年期	1.96	0	0
2 年期	1.95	0	-2
3 年期	1.99	-1	-4
4 年期	2.05	-2	-6
5 年期	2.12	-1	-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

四、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 81 支，规模合计 602.02 亿元；
短期融资券 15 支，规模合计 185.40 亿元；中期票据 143 支，规模合计 1237.71 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限波动 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 华能江苏 SCP005(科创票据)	1.75	30D	10.00	AAA	—
24 珠海港股 SCP002	1.90	31D	4.00	AA+	—
24 夏商 SCP010	1.95	37D	5.00	AA+	—
24 苏州高新 SCP031	1.85	51D	2.00	AAA	—
24 杭实投 SCP005	1.77	59D	15.00	AAA	—
24 广州控股 SCP005	1.76	59D	10.00	AAA	—
24 广州发展 SCP002B	1.75	60D	5.00	AAA	—
24 苏农垦 SCP006	2.05	72D	5.00	AAA	—
24 龙源电力 SCP011	1.75	85D	15.00	AAA	—
24 大唐租赁 SCP003	1.89	87D	5.00	AAA	—
24 国家能源 SCP013	1.70	88D	50.00	AAA	—
24 杭实投 SCP006	1.81	90D	10.00	AAA	—
24 雅砻江 SCP002	1.76	90D	5.00	AAA	—
24 泰州城建 SCP010	1.79	90D	3.72	AAA	—
24 昆山文商 SCP003	2.04	90D	2.00	AA	—
24 昆山文商 SCP004	2.04	90D	2.00	AA	—
24 象屿股份 SCP005	1.92	92D	10.00	AAA	—
24 东航 SCP006	1.66	93D	20.00	AAA	—
24 苏交通 SCP013	1.76	120D	10.00	AAA	—

24 江苏广电 SCP008(科创票据)	1.76	120D	5.00	AAA	—
24 苏州资产 SCP003	1.79	120D	3.00	AAA	—
24 滨湖建设 SCP011	1.89	120D	2.00	AA+	—
24 皖交控 SCP002	1.91	150D	10.00	AAA	—
24 东南国资 SCP004	1.90	150D	4.00	AAA	—
24 盐城东方 SCP003	2.08	150D	3.00	AA+	—
24 平安租赁 SCP008	1.82	155D	13.00	AAA	—
24 苏国信 SCP011	1.75	158D	5.00	AAA	—
24 越秀租赁 SCP003	1.84	160D	8.00	AAA	—
24 杭州热联 SCP007	1.95	178D	10.00	AA+	—
24 生物制药 SCP001	1.95	180D	15.00	AAA	—
24 湖南财信 SCP001	1.99	180D	5.00	AAA	—
24 渝医药 SCP005	2.09	180D	3.00	AA+	—
24 昆山文商 SCP002	2.05	180D	2.00	AA	—
24 国网租赁 SCP015	1.80	210D	10.00	AAA	—
24 象屿 SCP002	2.05	238D	20.00	AAA	—
24 国新租赁 SCP003	1.83	248D	10.00	AAA	—
24 津渤海 SCP009	2.25	250D	10.00	AAA	—
24 武金控 SCP005	2.11	252D	7.00	AAA	—
24 南航集 SCP004	1.84	267D	11.60	AAA	—
24 融和融资 SCP005	1.88	267D	5.00	AAA	—
24 华电租赁 SCP004	2.00	268D	5.00	AAA	—
24 佛山建设 SCP001	1.93	268D	5.00	AA+	—
24 海亮 SCP002	4.10	268D	5.00	AA+	—
24 华宝都鼎 SCP002	1.95	268D	3.00	AAA	—
24 中航租赁 SCP004	1.85	269D	7.00	AAA	—
24 粤环保 SCP003	1.92	269D	5.00	AAA	—
24 中拓 SCP008	2.01	269D	5.00	AA+	—
24 高淳国资 SCP004	2.15	269D	4.00	AA+	—
24 杭城投 SCP003	1.78	270D	20.00	AAA	—
24 新华水力 SCP003	2.12	270D	20.00	AA+	—
24 江西交投 SCP004	1.77	270D	15.00	AAA	—
24 晋江城投 SCP003	2.13	270D	12.90	AA+	—
24 曹妃国控 SCP001	2.23	270D	12.25	AA+	—
24 国宏投资 SCP001	2.05	270D	10.00	AA+	—
24 北辰科技 SCP005	2.20	270D	9.64	AA+	—
24 武清国资 SCP004	2.19	270D	9.35	AA+	—
24 顺丰泰森 SCP003	1.85	270D	8.00	AAA	—
24 福州地铁 SCP002	1.93	270D	8.00	AAA	—
24 荆州城发 SCP001	2.13	270D	6.38	AA+	—
24 天津轨交 SCP008	2.09	270D	6.00	AAA	—
24 红狮 SCP004	2.18	270D	6.00	AAA	—

24 深特发 SCP001	2.00	270D	6.00	AA+	—
24 滨建投 SCP006	2.14	270D	5.00	AAA	—
24 广州发展 SCP002A	1.87	270D	5.00	AAA	—
24 溧水经开 SCP003	2.15	270D	5.00	AA+	—
24 盐城国投 SCP001	2.20	270D	5.00	AA+	—
24 曲江金融 SCP002	3.60	270D	5.00	AA+	—
24 瀛洲发展 SCP002	2.20	270D	5.00	AA	—
24 天津轨交 SCP007	2.13	270D	4.00	AAA	—
24 江西金融 SCP002	2.20	270D	4.00	AA+	—
24 厦门海翼 SCP003	2.01	270D	3.00	AA+	—
24 创元投资 SCP005	1.91	270D	3.00	AA+	—
24 保利久联 SCP004	2.40	270D	3.00	AA+	—
24 创元投资 SCP004	1.91	270D	3.00	AA+	—
24 河南路桥 SCP001	3.00	270D	3.00	AA	—
24 易鑫租赁 SCP002	3.50	270D	2.50	AA+	—
24 锡交通 SCP004	1.82	270D	2.00	AAA	—
24 锡交通 SCP003	1.82	270D	2.00	AAA	—
24 瀚瑞投资 SCP005	2.19	270D	1.55	AA+	—
24 金禹能源 SCP001	2.29	270D	1.13	AA	—
24 南通高新 SCP001	2.10	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 苏农垦 CP003	1.85	85D	5.00	AAA	—
24 荆门城建 CP001	2.13	280D	7.00	AA	—
24 南电 CP010	1.85	355D	13.00	AAA	—
24 电网 CP002	1.94	365D	40.00	AAA	—
24 电网 CP001	1.92	365D	30.00	AAA	—
24 海淀国资 CP001	2.13	365D	30.00	AAA	—
24 电网 CP003	1.94	365D	20.00	AAA	—
24 新希望 CP001 (科创票据)	3.50	365D	10.00	AAA	—
24 景国资 CP002	2.20	365D	10.00	AA+	—
24 宜昌高新 CP001	2.12	365D	5.00	AA+	—
24 高淳建设 CP010	2.15	365D	5.00	AA	—
24 哈城投 CP001	2.15	365D	4.00	AA+	—
24 宁河西 CP002	1.90	365D	3.90	AAA	—
24 如皋经贸 CP003	1.96	365D	2.00	AA+	—
24 凤城河 CP003	2.06	365D	0.50	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 昆明轨道 MTN003	2.38	1.01	5.00	AAA	—
24 临桂城投 MTN001	2.45	1.01	6.70	AA	—
24 蚌埠经开 MTN001	2.35	1.15	0.50	AA	—

24 拜耳 MTN001BC	2.20	2.00	20.00	AAA	AAA
24 宝马中国 MTN001A(BC)	2.10	2.00	20.00	AAA	-
24 美的置业 MTN003	4.28	2.00	12.00	AAA	AAA
24 平安租赁 MTN008	2.31	2.00	5.00	AAA	-
24 平安租赁 MTN007	2.31	2.00	5.00	AAA	-
24 中陕核工 MTN001	2.40	2.00	4.00	AA+	AA+
24 云建投 MTN012	2.80	2.95	10.00	AAA	-
24 金茂投资 MTN001	2.80	3.00	30.00	AAA	AAA
24 南航集 MTN001	2.21	3.00	24.00	AAA	-
24 中色 MTN002	2.25	3.00	20.00	AAA	-
24 中电投 MTN009	2.26	3.00	18.00	AAA	-
24 豫航空港 MTN010	2.47	3.00	15.00	AAA	-
24 宝马中国 MTN001B(BC)	2.29	3.00	15.00	AAA	-
24 华电股 MTN002	2.13	3.00	15.00	AAA	-
24 胶州城投 MTN002	2.46	3.00	12.83	AA+	-
24 闽能源 MTN003	2.21	3.00	12.00	AAA	-
24 津渤海 MTN005	2.90	3.00	10.00	AAA	-
24 新兴际华 MTN002	2.30	3.00	10.00	AAA	-
24 首创集 MTN003A	2.22	3.00	10.00	AAA	AAA
24 鄂联投 MTN004	2.48	3.00	10.00	AAA	-
24 湖州城投 MTN001	2.36	3.00	10.00	AAA	-
24 招金 MTN002(科创票据)	2.26	3.00	10.00	AAA	-
24 湘建工 MTN002(科创票据)	2.67	3.00	10.00	AAA	-
24 中核汇能 MTN003	2.29	3.00	10.00	AAA	AAA
24 晋路桥 MTN002(科创票据)	2.70	3.00	10.00	AA+	-
24 潍坊城建 MTN005A	2.60	3.00	8.00	AAA	-
24 中电投 MTN008A	2.25	3.00	8.00	AAA	-
24 北部湾 MTN008	2.30	3.00	8.00	AAA	-
24 苏州高新 MTN006	2.15	3.00	8.00	AAA	-
24 苏州国际 MTN004	2.15	3.00	8.00	AAA	-
24 四川路桥 MTN002	2.20	3.00	7.00	AAA	-
24 建安投资 MTN001	2.37	3.00	6.20	AA+	-
24 镇江产投 MTN003	2.34	3.00	6.00	AAA	-
24 新海连 MTN003	2.40	3.00	6.00	AA+	-
24 威宁投资 MTN005	2.50	3.00	6.00	AA+	-
24 安东控股 MTN002	2.51	3.00	5.60	AA	-
24 越秀租赁 MTN002A(绿色)	2.22	3.00	5.00	AAA	-
24 大连港 MTN003A	2.24	3.00	5.00	AAA	-
24 融和融资 MTN003(碳中和债)	2.19	3.00	5.00	AAA	-
24 中铝 MTN002(转型)	2.19	3.00	5.00	AAA	-
24 西安高新 MTN010A	2.38	3.00	5.00	AAA	-
24 津城建 MTN024A	2.47	3.00	5.00	AAA	-

24 淄博城资 MTN003A	2.32	3.00	5.00	AAA	—
24 中联投资 MTN002A	2.28	3.00	5.00	AAA	AAA
24 西江 MTN003	3.30	3.00	5.00	AA+	—
24 海安开投 MTN001	2.35	3.00	5.00	AA+	—
24 赣租 MTN001	2.90	3.00	5.00	AA+	—
24 黄海金融 MTN001	2.46	3.00	5.00	AA+	—
24 温州能源 MTN001	2.25	3.00	5.00	AA+	—
24 浙越资产 MTN001	2.72	3.00	5.00	AA	—
24 甘肃电投 MTN001	2.40	3.00	5.00	AA	AAA
24 广西旅发 MTN005A	2.30	3.00	3.00	AA+	—
24 兴泰租赁 MTN001	3.00	3.00	3.00		—
24 苏州港 MTN002	2.30	3.00	2.00	AA+	—
24 汤山建设 MTN001	2.43	3.00	1.60	AA+	—
24 淮北建投 MTN009	2.38	3.00	0.88	AA+	—
24 湘高速 MTN006	2.20	4.00	20.00	AAA	—
24 陕有色 MTN003	2.50	5.00	20.00	AAA	AAA
24 东城国资 MTN001	2.20	5.00	20.00	AAA	—
24 江东控股 MTN002	2.23	5.00	15.99	AA+	—
24 中铁股 MTN002A	2.30	5.00	15.00	AAA	AAA
24 泸州窖 MTN003	2.34	5.00	15.00	AAA	—
24 津城建 MTN023	2.83	5.00	15.00	AAA	AAA
24 常德城投 MTN001	2.49	5.00	15.00	AA+	—
24 科学城 MTN001	2.37	5.00	13.80	AAA	—
24 淄博城资 MTN003B	2.65	5.00	13.00	AAA	—
24 泸州发展 MTN001	2.40	5.00	12.00	AA+	—
24 东方新城 MTN004	2.36	5.00	11.20	AA+	—
24 温江兴蓉 MTN002	2.55	5.00	11.00	AA+	—
24 娄底城发 MTN001	2.96	5.00	10.30	AA	—
24 冀中能源 MTN011(科创票据)	3.74	5.00	10.00	AAA	—
24 西基投 MTN001	2.35	5.00	10.00	AAA	—
24 鄂联投 MTN005	2.58	5.00	10.00	AAA	—
24 湖北宏泰 MTN002	2.45	5.00	10.00	AAA	AAA
24 中铝业 MTN002	2.33	5.00	10.00	AAA	—
24 中国电子 MTN002	2.42	5.00	10.00	AAA	—
24 两江产业 MTN002(科创票据)	2.36	5.00	10.00	AAA	—
24 豫航空港 MTN011	2.75	5.00	10.00	AAA	—
24 津城建 MTN024B	2.81	5.00	10.00	AAA	—
24 中电投 MTN008B	2.40	5.00	10.00	AAA	—
24 华发集团 MTN010	2.57	5.00	10.00	AAA	AAA
24 陕投集团 MTN003	2.26	5.00	10.00	AAA	—
24 陕延油 MTN009	2.40	5.00	10.00	AAA	AAA
24 中联投资 MTN002B	2.40	5.00	10.00	AAA	AAA

24 长虹电子 MTN002(科创票据)	2.80	5.00	10.00	AA+	—
24 柳州东投 MTN001	3.70	5.00	10.00	AA+	—
24 日照城投 MTN001	2.76	5.00	10.00	AA+	—
24 天健集 MTN001	2.44	5.00	10.00	AA+	—
24 铜陵建投 MTN002	2.50	5.00	9.90	AA	—
24 丰城发投 MTN002	2.69	5.00	9.40	AA+	—
24 宁河西 MTN003	2.41	5.00	9.00	AAA	—
24 桂交投 MTN012A	2.47	5.00	9.00	AAA	—
24 株洲云龙 MTN001	3.08	5.00	9.00	AA	AA+
24 威海城投 MTN002B	2.60	5.00	8.00	AA+	—
24 抚州投资 MTN001	2.63	5.00	8.00	AA+	—
24 越秀租赁 MTN002B(绿色)	2.30	5.00	7.00	AAA	—
24 德清建设 MTN002	2.18	5.00	6.21	AA+	—
24 华靖资产 MTN004	2.59	5.00	6.00	AA+	—
24 兴创投资 MTN003	2.20	5.00	5.20	AA+	—
24 简阳发展 MTN001	2.80	5.00	5.20	AA	AAA
24 铁物资 MTN001	2.41	5.00	5.00	AAA	AAA
24 大连港 MTN003B	2.34	5.00	5.00	AAA	—
24 西安高新 MTN010B	2.55	5.00	5.00	AAA	—
24 中燃投资 MTN002	2.29	5.00	5.00	AAA	—
24 乌交旅 MTN003	2.59	5.00	5.00	AA+	—
24 泉州文旅 MTN002	2.39	5.00	5.00	AA+	—
24 吉首华泰 MTN001	3.30	5.00	5.00	AA	—
24 武清经开 MTN005	3.20	5.00	5.00	AA	—
24 孝感高创 MTN001	2.65	5.00	5.00	AA	—
24 沛县城投 MTN001	2.45	5.00	5.00	AA	—
24 亳州城建 MTN002	2.69	5.00	5.00	AA	—
24 云天化 MTN004(科创票据)	2.88	5.00	4.00	AA+	—
24 广西旅发 MTN005B	2.77	5.00	4.00	AA+	—
24 冀中峰峰 MTN003	2.75	5.00	4.00	AA+	—
24 海盐国资 MTN001	2.25	5.00	3.50	AA+	—
24 威海城投 MTN002A	2.28	5.00	3.30	AA+	—
24 亦庄投资 MTN002A	2.36	5.00	3.00	AAA	AAA
24 漳州资本 MTN001	2.33	5.00	3.00	AA+	AA+
24 青岛军民 MTN002	2.61	5.00	3.00	AA+	—
24 大足永晟 MTN002	2.71	5.00	2.00	AA	—
24 太湖湾 MTN002	2.56	5.00	2.00	AA	—
24 宿迁水务 MTN004	2.36	5.00	0.60	AA+	—
24 云能投 GN001	3.07	7.00	12.00	AAA	—
24 潍坊城建 MTN005B	3.66	7.00	5.00	AAA	—
24 中铁股 MTN002B	2.53	10.00	15.00	AAA	AAA
24 中电国际 GN002	2.58	10.00	15.00	AAA	—

24 豫交投 MTN005	2.65	10.00	15.00	AAA	AAA
24 中粮 MTN001	2.53	10.00	10.00	AAA	AAA
24 湖南钢铁 GN001(科创票据)	2.65	10.00	10.00	AAA	AAA
24 首创集 MTN003B	2.75	10.00	10.00	AAA	AAA
24 中交投 MTN003A	2.67	10.00	8.00	AAA	AAA
24 川高速 MTN008	2.65	10.00	8.00	AAA	AAA
24 亦庄投资 MTN002B	2.65	10.00	7.00	AAA	AAA
24 汉江国资 MTN002	2.73	10.00	6.00	AAA	—
24 常高新 MTN003	2.75	10.00	5.80	AAA	AAA
24 广州发展 MTN003	2.56	10.00	5.00	AAA	AAA
24 中国中煤 MTN002	2.53	10.00	5.00	AAA	AAA
24 桂交投 MTN012B	2.89	10.00	5.00	AAA	—
24 中交投 MTN003B	2.78	15.00	7.00	AAA	AAA
24 江西交投 MTN008	2.63	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

◆ 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 5BP，上周收于 2.05%；6 个月品种收益率较前周上行 6BP，上周收于 2.10%；1 年期品种收益率较前周上行 4BP，上周收于 2.17%。
- 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 2BP，上周收于 2.21%；5 年期品种收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.39%。
- 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 1BP，上周收于 2.17%；5 年期品种收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.30%；10 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.52%。

五、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 3.4BP，上周收于 4.255%。
- 德国国债价格下跌，10 年期德国国债收益率较前周上行 5.2BP，上周收于 2.412%。

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	4.732	2.8	-14.1	48.2
5 年	4.274	3.6	-23.3	42.7
10 年	4.255	3.4	-24.4	37.6
30 年	4.397	4.8	-25.0	36.9
德国国债	收盘收益率 (%)	较前周 (BP)	较上月末 (BP)	较去年末 (BP)
2 年	2.789	2.6	-30.8	38.5
5 年	2.415	4.2	-29.2	46.7
10 年	2.412	5.2	-25.2	38.8
30 年	2.600	8.8	-18.4	33.7

数据来源：Bloomberg

◆ 利率掉期市场

- 美元利率掉期率震荡上行，10 年期美元利率掉期率较前周上行 4.16BP，上周收于 3.8556%。

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	4.5570	1.48	-22.28	49.13
10 年	3.8556	4.16	-27.35	38.16
30 年	3.6314	5.32	-26.82	31.53

数据来源：Bloomberg

六、贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周下跌 0.52%，上周最高 2368.60 美元/盎司、最低 2306.45 美元/盎司，收于 2320.35 美元/盎司。
- 白银价格较前周下跌 0.07%，上周最高 30.85 美元/盎司、最低 28.91 美元/盎司，收于 29.52 美元/盎司。
- 铂金价格较前周上涨 3.62%，上周最高 1004.20 美元/盎司、最低 943.93 美元/盎司，收于 992.45 美元/盎司。
- 钯金价格较前周上涨 6.56%，上周最高 1027.05 美元/盎司、最低 867.51 美元/盎司，收于 948.68 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	2320.35	-0.52%	-0.28%
白银	29.52	-0.07%	-2.81%
铂金	992.45	3.62%	-4.36%
钯金	948.68	6.56%	3.92%

数据来源：Refinitiv

七、原油市场上周概览

- WTI 原油期货主力合约价格较前周上涨 3.23%，上周最高 81.79 美元/桶、最低 77.58 美元/桶，收于 80.59 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 2.53%，上周最高 85.30 美元/桶、最低 81.54 美元/桶，收于 84.18 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	80.59	3.23%	4.84%

ICE Brent 主力合约	84.18	2.53%	3.77%
----------------	-------	-------	-------

数据来源: Refinitiv

八、基本金属市场上周概览

- LME3 月期铜价格较前周下跌 0.95%，上周最高 9883.50 美元/吨、最低 9680.00 美元/吨，收于 9680.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周下跌 0.40%，上周最高 2523.00 美元/吨、最低 2489.50 美元/吨，收于 2513.00 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	9680.00	-0.95%	-3.86%
LME 3 月铝	2513.00	-0.40%	-5.35%

数据来源: Bloomberg

九、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 2.44%，上周最高 1149.75 美分/蒲式耳、最低 1113.25 美分/蒲式耳，收于 1121.00 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)	577.00	-8.01%	-17.72%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1121.00	-2.44%	-5.38%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	453.25	-3.31%	-2.89%
ICE 棉花(美分/磅)	72.33	0.12%	-3.60%
ICE 白糖(美分/磅)	19.17	-1.34%	4.70%

数据来源: Refinitiv

十、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 3.98%，上周最高 3.027 美元/百万英热单位、最低 2.793 美元/百万英热单位，收于 2.848 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	2.848	-3.98%	7.31%

数据来源：Refinitiv