

# 工银市场周报 (7月15日-7月19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

2024年7月22日

2024年第26期 总第577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。

## 目录

- 一、人民币汇率市场上周概览** . . . . . 1
  - ◆人民币中间价上周五报 7.1315, 与前周持平; 银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.12%, 上周收于 7.2672; 1年期掉期点较前周上行 4 个点, 上周收于-2890。
  - ◆1年期境外美元对人民币无本金交割远期(NDF)较前周上行 30 个点, 上周收于 7.0625。
- 二、外币汇率市场上周概览** . . . . . 2
  - ◆美元指数较前周上涨 0.29%, 上周收于 104.396。
  - ◆欧元兑美元较前周下跌 0.27%, 上周收于 1.0877。
  - ◆美元兑日元较前周下跌 0.25%, 上周收于 157.49。
  - ◆澳元兑美元较前周下跌 1.49%, 上周收于 0.6682。
- 三、人民币利率市场上周概览** . . . . . 3
  - ◆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 1.86%和 1.90%, 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 1.86%和 1.90%。
  - ◆二级市场: 10年期国债收益率与前周基本持平, 上周收于 2.27%; 5年期国债收益率较前周下行 1BP, 上周收于 2.02%。
  - ◆一级市场: 财政部招标发行 182 天期贴现国债, 以及 1 年、7 年和 30 年期附息国债。农发行招标发行 0.25 年、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: 共发行超短期融资券 72 支, 规模合计 663.51 亿元; 短期融资券 9 支, 规模合计 86.75 亿元; 中期票据 113 支, 规模合计 1053.33 亿元。
  - ◆二级市场: 短期融资券收益率区间震荡, 中期票据收益率震荡上行, 企业债收益率小幅下行。
- 五、外币利率市场上周概览** . . . . . 11
  - ◆美国国债价格下跌, 10 年期美国国债收益率较前周上行 5.6BP, 上周收于 4.239%。
  - ◆德国国债价格上涨, 10 年期德国国债收益率较前周下行 2.9BP, 上周收于 2.467%。
- 六、贵金属市场上周概览** . . . . . 12
  - ◆黄金价格较前周下跌 0.43%, 上周收于 2400.79 美元/盎司。
  - ◆白银价格较前周下跌 4.91%, 上周收于 29.26 美元/盎司。
  - ◆铂金价格较前周下跌 3.59%, 上周收于 962.50 美元/盎司。
  - ◆钯金价格较前周下跌 6.51%, 上周收于 905.97 美元/盎司。
- 七、原油市场上周概览** . . . . . 13
  - ◆WTI 原油期货主力合约价格较前周下跌 2.93%, 上周收于 78.60 美元/桶。
  - ◆BRENT 原油期货主力合约价格较前周下跌 3.18%, 上周收于 82.56 美元/桶。
- 八、基本金属市场上周概览** . . . . . 14
  - ◆LME3 月期铜价格较前周下跌 5.94%, 上周收于 9290.00 美元/吨。
- 九、农产品市场上周概览** . . . . . 14
  - ◆CBOT 大豆期货主力合约价格较前周下跌 2.72%, 上周收于 1035.50 美分/蒲式耳。
- 十、天然气市场上周概览** . . . . . 14
  - ◆NYMEX 天然气期货主力合约价格较前周下跌 8.17%, 上周收于 2.124 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：人民币中间价上周五（7月19日）报 7.1315，与前周持平。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.12%，上周最高 7.2500、最低 7.2699，收于 7.2672，波幅为 0.27%。
- 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 4 个点，上周最高-2838、最低-2932，收于 -2890，波幅为 3.25%。
- 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 30 个点，上周最高 7.0878、最低 7.0485，17:00 收于 7.0625，波幅为 0.56%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	7.1315	0	47	488
银行间市场汇价	7.2699	7.2500	7.2672	87	13	1752
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	-238	-256	-243	-3	-11	-35
2 个月期限	-487	-498	-493	5	-6	-70
3 个月期限	7	-751	-735	-11	39	-100
6 个月期限	-697	-1503	-1478	-11	11	-230
1 年期限	-2838	-2932	-2890	4	70	-475

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 (点)	较去年末 (点)	与境内价 差(点)
1 个月期限	7.1445	7.1004	7.1260	35	525	-1169

2 个月期限	7.1470	7.0949	7.1245	30	620	-934
3 个月期限	7.1485	7.0930	7.1220	25	730	-717
6 个月期限	7.1425	7.0805	7.1080	5	965	-114
1 年期限	7.0878	7.0485	7.0625	30	1140	843

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 0.29%，上周最高 104.510、最低 103.650，收于 104.396。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.27%，上周最高 1.0947、最低 1.0870，收于 1.0877。
- 美元兑日元较前周下跌 0.25%，上周最高 158.85、最低 155.36，收于 157.49。
- 澳元兑美元较前周下跌 1.49%，上周最高 0.6788、最低 0.6679，收于 0.6682。

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	104.396	0.29%	-1.39%
欧元/美元	1.0877	-0.27%	1.53%
美元/日元	157.49	-0.25%	-2.08%
澳元/美元	0.6682	-1.49%	0.22%

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 1.86% 和 1.90%，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 1.86% 和 1.90%。央行公开市场方面，上周一（7 月 15 日）进行逆回购操作 1290 亿元和 MLF 操作 1000 亿元，逆回购到期 20 亿元；上周二（7 月 16 日）进行逆回购操作 6760 亿元，逆回购到期 20 亿元；上周三（7 月 17 日）进行逆回购操作 2700 亿元，逆回购到期 20 亿元和 MLF 到期 1030 亿元；上周四（7 月 18 日）进行逆回购操作 490 亿元，逆回购到期 20 亿元；上周五进行逆回购操作 590 亿元，逆回购到期 20 亿元。本周（7 月 22 日-7 月 26 日）将有逆回购到期 11700 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)	1.86	19	-3
7 天 Shibor (1W)	1.86	5	-24
3 月期 Shibor (3M)	1.90	0	-2
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.90	17	-30
7 天回购定盘利率 (FR007)	1.90	6	-40

数据来源：银行间外汇交易中心

## ◆ 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下行 1BP，上周收于 1.53%；5 年期国债收益率较前周下行 2BP，上周收于 1.96%；10 年期国债收益率与前周基本持平，上周收于 2.27%。
- 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 2BP，上周收于 1.74%；5 年期国开债收益率

较前周下行 1BP，上周收于 2.02%；10 年期国开债收益率与前周基本持平，上周收于 2.34%。

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	1.53	-1	-1
3 年期	1.78	0	0
5 年期	1.96	-2	-1
7 年期	2.10	-1	0
10 年期	2.27	0	4

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	1.74	2	4
3 年期	1.95	-1	6
5 年期	2.02	-1	0
7 年期	2.15	-3	-3
10 年期	2.34	0	3

数据来源：工商银行

## ◆ 一级市场

- 国债方面，上周三财政部发行 1 年、7 年和 30 年期付息国债；上周五财政部发行 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 0.25 年、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、7 年和 10 年期固息债；进出口行招标发行 1 年、3 年和 10 年期固息债；上周五国开行招标发行 5 年期固息债。

## ◆ 利率互换市场

- 利率互换方面，收益率小幅下行。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下行 1BP 至 3BP；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区间-3BP 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)
<b>7 天 Repo (ACT/365)</b>			
3 月期	1.86	-1	-4
6 月期	1.87	-2	-1
9 月期	1.85	-2	-1
1 年期	1.83	-2	-1
3 年期	1.86	-1	1
4 年期	1.91	-1	1
5 年期	1.96	-2	-1
7 年期	2.06	-3	-1
10 年期	2.15	-2	0
<b>3 月 Shibor (ACT/360)</b>			
6 月期	1.89	1	-1
9 月期	1.91	-1	-3
1 年期	1.91	-1	-2
2 年期	1.90	-1	-2
3 年期	1.93	0	-2
4 年期	1.97	-2	-4
5 年期	2.03	-3	-4
<b>1 年 Depo (ACT/365)</b>			
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 72 支，规模合计 663.51 亿元；短期融资券 9 支，规模合计 86.75 亿元；中期票据 113 支，规模合计 1053.33 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限震荡上行 0BP 至 4BP。

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	债券评级
24 沪电力 SCP013	1.70	30D	17.00	AAA	-
24 华能 SCP007	1.62	32D	45.00	AAA	-
24 华电江苏 SCP010	1.96	33D	5.00	AAA	-
24 华电江苏 SCP009	1.86	41D	5.00	AAA	-
24 华能江苏 SCP006 (科创票据)	1.73	43D	10.00	AAA	-
24 华能集 SCP005	1.65	66D	20.00	AAA	-
24 华能水电 SCP005	1.90	72D	10.00	AAA	-
24 苏州高新 SCP036	1.85	72D	5.00	AAA	-
24 粤海 SCP005	1.70	90D	30.00	AAA	-
24 东航 SCP007	1.67	90D	20.00	AAA	-
24 东航 SCP008	1.67	90D	20.00	AAA	-
24 中化国际 SCP004	1.68	90D	12.00	AAA	-
24 国能新能 SCP002	1.72	90D	10.00	AAA	-
24 冀建投 SCP001	1.90	90D	5.00	AAA	-
24 夏商 SCP011	1.78	90D	5.00	AA+	-
24 宁沪高 SCP013	1.72	93D	6.00	AAA	-
24 宁沪高 SCP012	1.72	93D	5.00	AAA	-
24 宁沪高 SCP011	1.72	93D	5.00	AAA	-
24 宁沪高 SCP010	1.72	93D	4.50	AAA	-
24 苏交通 SCP016	1.71	120D	20.00	AAA	-
24 凯盛科技 SCP008	1.82	143D	5.00	AAA	-

24 许昌投资 SCP002	2.07	150D	10.00	AA+	-
24 中交建 SCP006	1.82	156D	30.00	AAA	-
24 苏州高新 SCP035	1.86	158D	2.00	AAA	-
24 山东港口 SCP002	1.77	160D	10.00	AAA	-
24 浪潮电子 SCP005(科创票据)	1.80	162D	10.00	AAA	-
24 宝钢 SCP005	1.78	179D	20.00	AAA	-
24 滨湖建设 SCP014	1.90	179D	2.00	AA+	-
24 中航租赁 SCP005	1.77	180D	10.00	AAA	-
24 浙国贸 SCP001	1.82	180D	8.00	AAA	-
24 福州水务 SCP002	1.88	180D	5.00	AAA	-
24 苏州资产 SCP004	1.84	180D	3.00	AAA	-
24 中燃投资 SCP002	1.79	205D	4.20	AAA	-
24 华数 SCP004	1.76	211D	5.00	AAA	-
24 国网租赁 SCP017	1.79	226D	20.00	AAA	-
24 华宝都鼎 SCP003	1.85	226D	3.00	AAA	-
24 大唐租赁 SCP004	1.92	240D	15.00	AAA	-
24 徐工集团 SCP012	1.74	247D	8.00	AAA	-
24 金外滩 SCP002	2.04	254D	5.00	AAA	-
24 广州工投 SCP005	1.80	255D	15.00	AAA	-
24 吴中国太 SCP010	2.07	266D	1.80	AA+	-
24 一汽租赁 SCP006	1.89	267D	10.00	AAA	-
24 鲁钢铁 SCP007	1.90	268D	15.00	AAA	-
24 金鼎产融 SCP003	2.30	268D	10.00	AA+	-
24 张江高科 SCP001	1.88	269D	10.00	AAA	-
24 华电租赁 SCP005	1.85	269D	5.00	AAA	-
24 吉利 SCP003(科创票据)	1.85	270D	20.00	AAA	-
24 湖北港口 SCP003	1.97	270D	12.00	AAA	-
24 济南高新 SCP004	2.05	270D	12.00	AAA	-
24 广州控股 SCP006	1.81	270D	10.00	AAA	-
24 邯郸城投 SCP002	2.06	270D	10.00	AA+	-
24 昆明交通 SCP004	2.45	270D	8.00	AAA	-
24 曲文投 SCP001	2.74	270D	8.00	AA+	-
24 宿迁新城 SCP004	2.10	270D	7.07	AA	-
24 豫园商城 SCP003	3.80	270D	6.00	AAA	-
24 福州古厝 SCP004	1.89	270D	5.00	AAA	-
24 绍兴交投 SCP003	2.00	270D	5.00	AAA	-
24 甬开投 SCP002	2.03	270D	5.00	AAA	-
24 广东农垦 SCP004	1.81	270D	5.00	AAA	-
24 桐昆 SCP009(科创票据)	1.96	270D	5.00	AA+	-
24 镇海投资 SCP001	2.05	270D	5.00	AA+	-
24 新都香城 SCP001	2.09	270D	5.00	AA	-
24 顺鑫 SCP002	2.10	270D	5.00	AA	-

24 宿迁城投 SCP001	2.00	270D	4.94	AA+	-
24 太湖新城 SCP003	1.77	270D	4.00	AAA	-
24 新投 SCP002	2.07	270D	4.00	AA+	-
24 吴中城投 SCP004	2.04	270D	3.10	AA+	-
24 海宁皮革 SCP002	1.85	270D	3.00	AA+	-
24 黄石城投 SCP002	2.13	270D	3.00	AA	-
24 河南路桥 SCP002	2.88	270D	3.00	AA	-
24 青岛西海 SCP001	2.07	270D	2.90	AAA	-
24 南通经开 SCP001	2.05	270D	1.00	AAA	-
短期融资券					
	发行利率 (%)	发行期限 (天)	发行规模 (亿元)	主体评级	债券评级
24 义乌国资 CP001	2.04	365D	20.00	AAA	A-1
24 昆明土地 CP001	2.73	365D	20.00	AA+	-
24 恒力石化 CP001 (科创票据)	2.20	365D	10.00	AAA	-
24 荣盛 CP002	2.09	365D	10.00	AAA	-
24 静海城投 CP001	2.18	365D	10.00	AA+	-
24 临沂城投 CP003	1.98	365D	5.10	AAA	-
24 恒力 CP003 (科创票据)	2.50	365D	5.00	AAA	-
24 新盛投资 CP002	2.13	365D	5.00	AA	-
24 青岛城发 CP001	2.07	365D	1.65	AA	-
中期票据					
	发行利率 (%)	发行期限 (天)	发行规模 (亿元)	主体评级	债券评级
24 昆明交通 MTN001	2.50	1.01	18.00	AAA	-
24 国新保理 MTN003	2.17	2.00	8.00	AAA	-
24 南京高科 MTN002	2.20	2.00	7.50	AA+	-
24 冀中能源 MTN012A (科创票据)	2.60	2.00	5.00	AAA	-
24 龙源电力 MTN001	2.07	3.00	20.00	AAA	-
24 国电 MTN001	2.02	3.00	20.00	AAA	-
24 中电投 MTN010	1.99	3.00	20.00	AAA	-
24 中电投 MTN012	1.97	3.00	19.00	AAA	-
24 首钢 MTN003A	2.18	3.00	15.00	AAA	AAA
24 中电投 MTN011A	2.18	3.00	12.00	AAA	-
24 华发集团 MTN012	2.51	3.00	11.00	AAA	AAA
24 昆明轨道 MTN004	3.00	3.00	10.00	AAA	-
24 申能股 MTN001 (碳中和债)	2.00	3.00	10.00	AAA	AAA
24 贵州高速 MTN006	2.23	3.00	10.00	AAA	-
24 河钢集 MTN010	2.32	3.00	10.00	AAA	-
24 沪国际 MTN002	2.15	3.00	10.00	AAA	-
24 中交地产 MTN002	2.84	3.00	10.00	AA+	-
24 义乌城投 MTN001	2.22	3.00	10.00	AA+	-
24 西安航天 MTN001	2.48	3.00	10.00	AA+	-
24 晋路桥 MTN003 (科创票据)	2.47	3.00	10.00	AA+	-

24 西南水泥 MTN002B	2.25	3.00	7.00	AAA	-
24 香格里拉 MTN002A (BC)	2.27	3.00	6.00	AAA	AAA
24 海发宝诚 MTN005	2.29	3.00	6.00	AAA	-
24 湖南能源 MTN005A	2.25	3.00	6.00	AA+	-
24 首旅 MTN011A	2.23	3.00	5.00	AAA	-
24 大连港 MTN004A	2.18	3.00	5.00	AAA	-
24 日照能源 MTN001	2.33	3.00	5.00	AA+	-
24 赣能 MTN001 (科创票据)	2.24	3.00	5.00	AA+	-
24 广西路桥 MTN004 (科创票据)	2.34	3.00	5.00	AA+	-
24 东湖高新 MTN001	2.50	3.00	5.00	AA	-
24 高淳国资 MTN002	2.26	3.00	4.80	AA+	-
24 淮安新城 MTN007	2.26	3.00	4.30	AA+	-
24 西安高新 MTN013A	2.34	3.00	4.00	AAA	-
24 亚盛实业 MTN001 (乡村振兴)	2.50	3.00	4.00	AA	AAA
24 相城高新 MTN001	2.28	3.00	4.00	AA	-
24 荆门高新 MTN004	2.29	3.00	3.84	AA	-
24 靖江北辰 MTN004	2.28	3.00	3.40	AA	-
24 冀中能源 MTN012B (科创票据)	2.90	3.00	3.00	AAA	-
24 金合盛 MTN004	2.25	3.00	3.00	AA	-
24 农垦 MTN002A	2.44	3.00	2.00	AA+	-
24 新余城建 MTN001	2.42	3.00	1.00	AA	-
24 云能投 MTN016	2.56	4.00	15.00	AAA	-
24 中石油 MTN001	2.13	5.00	60.00	AAA	-
24 中建投资 MTN002	2.30	5.00	20.00	AAA	AAA
24 京建工 MTN001 (科创票据)	2.26	5.00	20.00	AAA	-
24 长春轨交 MTN002	2.61	5.00	20.00	AA+	-
24 中节能 MTN003A	2.30	5.00	15.00	AAA	AAA
24 鲁黄金 MTN006 (科创票据)	2.32	5.00	15.00	AAA	AAA
24 宜兴城投 MTN004	2.30	5.00	15.00	AA+	-
24 合肥产投 MTN002A	2.27	5.00	13.06	AAA	-
24 厦国贸控 MTN010	2.55	5.00	12.00	AAA	AAA
24 松江国投 MTN001	2.20	5.00	11.90	AAA	-
24 义乌国资 MTN003	2.32	5.00	10.00	AAA	AAA
24 闽漳龙 MTN003	2.44	5.00	10.00	AAA	AAA
24 国联 MTN007	2.29	5.00	10.00	AAA	-
24 中燃气 MTN003	2.37	5.00	10.00	AAA	-
24 悦达 MTN002	2.92	5.00	10.00	AAA	-
24 赣金控 MTN003	2.36	5.00	10.00	AAA	AAA
24 新兴际华 MTN003	2.32	5.00	10.00	AAA	-
24 怀化水业 MTN001	3.15	5.00	10.00	AA	-
24 德阳发展 MTN002	2.45	5.00	8.69	AA+	-
24 中电投 MTN011B	2.32	5.00	8.00	AAA	-

24 镇江交通 MTN002	2.47	5.00	7.40	AA+	-
24 西宁城投 MTN003	3.45	5.00	7.10	AA+	-
24 上饶城投 MTN001	2.57	5.00	6.16	AA+	-
24 天津轨交 MTN005	2.49	5.00	6.00	AAA	-
24 重庆轻纺 MTN001	2.55	5.00	6.00	AA	AAA
24 电建地产 MTN002	2.68	5.00	5.40	AAA	-
24 徐州交通 MTN002	2.29	5.00	5.10	AAA	-
24 华数 MTN003	2.33	5.00	5.00	AAA	-
24 国联 MTN008	2.25	5.00	5.00	AAA	-
24 国药租赁 MTN004	2.40	5.00	5.00	AAA	-
24 中燃投资 MTN003	2.35	5.00	5.00	AAA	-
24 首旅 MTN011B	2.40	5.00	5.00	AAA	-
24 大连港 MTN004B	2.30	5.00	5.00	AAA	-
24 冀能股份 MTN002	3.34	5.00	5.00	AA+	-
24 三峡平湖 MTN003	2.55	5.00	5.00	AA+	-
24 珠海港 MTN001	2.35	5.00	5.00	AA+	-
24 鑫诚恒业 MTN002	2.90	5.00	5.00	AA+	-
24 农垦 MTN002B	2.70	5.00	5.00	AA+	-
24 金坛投资 MTN003	2.47	5.00	5.00	AA	-
24 德州财金 MTN001	2.49	5.00	4.40	AA+	AA+
24 香格里拉 MTN002B(BC)	2.50	5.00	4.00	AAA	AAA
24 西安高新 MTN013B	2.57	5.00	4.00	AAA	-
24 湖南能源 MTN005B	2.38	5.00	4.00	AA+	-
24 珠海港股 MTN004	2.31	5.00	4.00	AA+	-
24 泉州台集 MTN001B	2.46	5.00	3.30	AA+	-
24 西南水泥 MTN002A	2.40	5.00	3.00	AAA	-
24 泉州台集 MTN001A	2.28	5.00	3.00	AA+	-
24 栖霞科技 MTN004	2.48	5.00	2.00	AA	-
24 大足工业 MTN002	3.00	5.00	1.98	AA	-
24 西安浐灞 MTN002	3.42	5.00	0.90	AA	-
24 华阳新材 MTN008	2.67	7.00	10.00	AAA	-
24 潍坊投资 MTN004	3.25	7.00	5.00	AA+	-
24 张家经开 MTN001	2.54	7.00	3.10	AA+	-
24 中石油 MTN002	2.39	10.00	60.00	AAA	-
24 中铝集 MTN003(科创票据)	2.52	10.00	20.00	AAA	-
24 苏交通 MTN010	2.50	10.00	20.00	AAA	-
24 晋能煤业 MTN010	2.70	10.00	20.00	AAA	-
24 蜀道投资 MTN010A	2.57	10.00	15.00	AAA	AAA
24 中节能 MTN003B	2.60	10.00	15.00	AAA	AAA
24 粤电发 MTN002	2.54	10.00	15.00	AAA	AAA
24 洛阳国晟 MTN001	2.97	10.00	10.00	AAA	AAA
24 华为 MTN001	2.48	10.00	10.00	AAA	AAA

24 九龙江 MTN001A	2.64	10.00	6.00	AAA	AAA
24 首钢 MTN003B	2.55	10.00	5.00	AAA	AAA
24 建发集 MTN003	3.08	10.00	5.00	AAA	-
24 南昌建投 MTN005	2.60	10.00	3.00	AAA	-
24 合肥产投 MTN002B	2.63	10.00	3.00	AAA	-
24 九龙江 MTN001B	2.74	15.00	4.00	AAA	AAA
24 陕西交通 MTN006	2.71	20.00	20.00	AAA	AAA
24 蜀道投资 MTN010B	2.65	20.00	5.00	AAA	AAA
24 苏国信 MTN004	2.65	30.00	10.00	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，收益率区间震荡。AAA 级短期融资券中，1 个月品种收益率较前周上行 2BP，上周收于 1.94%；6 个月品种收益率较前周上行 1BP，上周收于 2.00%；1 年期品种收益率较前周下行 0.5BP，上周收于 2.06%。
- 中期票据方面，收益率震荡上行。AAA 级中期票据中，3 年期品种收益率与前周持平，上周收于 2.19%；5 年期品种收益率较前周上行 1BP，上周收于 2.36%。
- 企业债方面，收益率小幅下行。AAA 级企业债中，3 年期品种收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.11%；5 年期品种收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.23%；10 年期品种收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.47%。

## 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5.6BP，上周收于4.239%。
- 德国国债价格上涨，10年期德国国债收益率较前周下行2.9BP，上周收于2.467%。

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	4.511	6.0	-24.3	26.1
5 年	4.167	6.4	-21.0	31.9
10 年	4.239	5.6	-15.7	36.0
30 年	4.447	5.1	-11.2	41.9
<b>德国国债</b>				
2 年	2.784	-3.9	-4.9	38.0
5 年	2.421	-5.4	-6.1	47.3
10 年	2.467	-2.9	-3.3	44.3
30 年	2.664	-1.9	-2.7	40.1

数据来源：Bloomberg

### ◆ 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5.69BP，上周收于3.8040%。

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	4.3261	4.26	-28.21	26.04
10 年	3.8040	5.69	-17.50	33.00
30 年	3.6553	4.60	-10.37	33.92

数据来源：Bloomberg

## 六、贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周下跌0.43%，上周最高2483.60美元/盎司、最低2393.75美元/盎司，收于2400.79美元/盎司。

- 白银价格较前周下跌 4.91%，上周最高 31.42 美元/盎司、最低 28.85 美元/盎司，收于 29.26 美元/盎司。
- 铂金价格较前周下跌 3.59%，上周最高 1029.40 美元/盎司、最低 952.43 美元/盎司，收于 962.50 美元/盎司。
- 钯金价格较前周下跌 6.51%，上周最高 982.50 美元/盎司、最低 902.50 美元/盎司，收于 905.97 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	2400.79	-0.43%	3.23%
白银	29.26	-4.91%	0.45%
铂金	962.50	-3.59%	-3.09%
钯金	905.97	-6.51%	-6.83%

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下跌 2.93%，上周最高 82.27 美元/桶、最低 78.59 美元/桶，收于 78.60 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周下跌 3.18%，上周最高 85.81 美元/桶、最低 82.56 美元/桶，收于 82.56 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	78.60	-2.93%	-2.46%
ICE Brent 主力合约	82.56	-3.18%	-2.69%

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 5.94%，上周最高 9877.00 美元/吨、最低 9290.00 美元/吨，收于 9290.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周下跌 5.60%，上周最高 2489.50 美元/吨、最低 2350.00 美元/吨，收于 2350.00 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	9290.00	-5.94%	-3.09%
LME 3 月铝	2350.00	-5.60%	-6.65%

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 2.72%，上周最高 1064.00 美分/蒲式耳、最低 1031.75 美分/蒲式耳，收于 1035.50 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)	544.75	-1.18%	-5.30%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1035.50	-2.72%	-6.33%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	405.50	-2.58%	-3.80%
ICE 棉花(美分/磅)	70.78	-0.78%	-2.65%
ICE 白糖(美分/磅)	18.67	-2.76%	-8.07%

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 8.17%，上周最高 2.285 美元/百万英热单位、最低 2.015 美元/百万英热单位，收于 2.124 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	2.124	-8.17%	-18.34%

数据来源：Refinitiv