

工银市场周报 (8月5日-8月9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8月12日

2024年第32期 总第583期

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 7.1449, 较前周贬值约 0.10%; 银行间市场人民币汇率较前周升值约 0.56%, 上周收于 7.1746; 1年期掉期点较前周上行 329 个点, 上周收于-2435。
 - ◆1年期境外美元对人民币无本金交割远期 (NDF) 较前周下行 90 个点, 上周收于 6.9960。
- 二、外币汇率市场上周概览** 2
 - ◆美元指数较前周下跌 0.07%, 上周收于 103.135。
 - ◆欧元兑美元较前周上涨 0.07%, 上周收于 1.0916。
 - ◆美元兑日元较前周上涨 0.05%, 上周收于 146.61。
 - ◆澳元兑美元较前周上涨 0.97%, 上周收于 0.6572。
- 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 1.78%和 1.88%, 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 1.80%和 1.86%。
 - ◆二级市场: 10年期国债收益率较前周上行 7BP, 上周收于 2.19%; 5年期国债收益率较前周上行 5BP, 上周收于 1.98%。
 - ◆一级市场: 财政部招标发行 28天、63天、91天和 182天期贴现国债, 以及 2年、5年和 50年期附息国债; 农发行招标发行 3个月期、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 64支, 规模合计 554.50 亿元; 短期融资券 12支, 规模合计 84.56 亿元; 中期票据 144支, 规模合计 1428.48 亿元。
 - ◆二级市场: 短期融资券、中期票据和企业债收益率均震荡上行。
- 五、外币利率市场上周概览** 10
 - ◆美国国债价格下跌, 10年期美国国债收益率较前周上行 15.0BP, 上周收于 3.940%。
 - ◆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 2.225%。
- 六、贵金属市场上周概览** 11
 - ◆黄金价格较前周下跌 0.51%, 上周 2430.93 美元/盎司。
 - ◆白银价格较前周下跌 3.87%, 上周 27.44 美元/盎司。
 - ◆铂金价格较前周下跌 3.73%, 上周收于 922.16 美元/盎司。
 - ◆钯金价格较前周上涨 1.73%, 上周收于 905.20 美元/盎司。
- 七、原油市场上周概览** 11
 - ◆WTI 原油期货主力合约价格较前周上涨 3.83%, 上周收于 76.98 美元/桶。
 - ◆Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 2.45%, 上周收于 79.46 美元/桶。
- 八、基本金属市场上周概览** 12
 - ◆LME3 月期铜价格较前周下跌 2.82%, 上周收于 8831.00 美元/吨。
- 九、农产品市场上周概览** 12
 - ◆CBOT 大豆期货主力合约价格较前周下跌 2.67%, 上周收于 1001.50 美分/蒲式耳。
- 十、天然气市场上周概览** 13
 - ◆NYMEX 天然气期货主力合约价格较前周上涨 9.25%, 上周收于 2.161 美元/百万英热单位。

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

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周五（8月9日）报 7.1449，较前周贬值约 0.10%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 0.56%，上周最高 7.1120、最低 7.1870，收于 7.1746，波幅为 1.05%。
- 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 329 个点，上周最高-2430、最低-2621，收于 -2435，波幅为 7.84%。
- 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）较前周下行 90 个点，上周最高 7.0050、最低 6.8960，收于 6.9960，波幅为 1.56%。

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)
即期汇率						
中间价	-	-	7.1449	73	103	622
银行间市场汇价	7.1870	7.1120	7.1746	-404	-515	826
掉期点						
1 个月期限	-254	-305	-255.7	11	12	-48
2 个月期限	-517	-568	-517	17	49	-94
3 个月期限	-747	-830	-750.5	20	32	-116
6 个月期限	-1399	-1503	-1405	87	132	-157
1 年期限	-2430	-2621	-2435	329	443	-20

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	7.1440	7.0448	7.1300	95	565	-190
2 个月期限	7.1300	7.0257	7.1150	15	525	-79

3个月期限	7.1145	7.0066	7.0990	-65	500	-5
6个月期限	7.0720	6.9551	7.0580	-95	465	239
1年期限	7.0050	6.8960	6.9960	-90	475	649

数据来源: Refinitiv

二、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 103.546、最低 102.160，收于 103.135。
- 欧元兑美元较前周上涨 0.07%，上周最高 1.1008、最低 1.0881，收于 1.0916。
- 美元兑日元较前周上涨 0.05%，上周最高 147.89、最低 141.66，收于 146.61。
- 澳元兑美元较前周上涨 0.97%，上周最高 0.6605、最低 0.6346，收于 0.6572。

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	103.135	-0.07%	-0.92%
欧元/美元	1.0916	0.07%	0.84%
美元/日元	146.61	0.05%	-2.25%
澳元/美元	0.6572	0.97%	0.49%

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 1.78% 和 1.88%，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 1.80% 和 1.86%。央行公开市场方面，上周一 (8 月 5 日) 进行逆回

购操作 6.70 亿元，逆回购到期 3015.70 亿元；上周二（8 月 6 日）进行逆回购操作 6.20 亿元，逆回购到期 2162.70 亿元；上周三（8 月 7 日）未进行逆回购操作，逆回购到期 2516.70 亿元；上周四（8 月 8 日）进行逆回购操作 71.00 亿元，逆回购到期 103.70 亿元；上周五进行逆回购操作 129.00 亿元，逆回购到期 11.70 亿元。本周（8 月 12 日 - 8 月 16 日）将有逆回购到期 212.90 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)	1.78	21	0
7 天 Shibor (1W)	1.80	10	2
3 月期 Shibor (3M)	1.83	-2	-3
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.88	22	-12
7 天回购定盘利率 (FR007)	1.86	4	-4

数据来源：外汇交易中心

◆ 二级市场

- 国债方面，收益率震荡上行。1 年期国债收益率较前周上行 7BP，上周收于 1.46%；5 年期国债收益率较前周上行 4BP，上周收于 1.85%；10 年期国债收益率较前周上行 7BP，上周收于 2.19%。
- 政策性金融债方面，收益率震荡上行。1 年期国开债收益率较前周上行 5BP，上周收于 1.65%；5 年期国开债收益率较前周上行 5BP，上周收于 1.98%；10 年期国开债收益率较前周上行 5BP，上周收于 2.26%。

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	1.46	7	4

3 年期	1.67	4	-2
5 年期	1.85	4	2
7 年期	2.06	11	8
10 年期	2.19	7	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	1.65	5	0
3 年期	1.85	6	2
5 年期	1.98	5	3
7 年期	2.07	6	1
10 年期	2.26	5	2

数据来源：工商银行

◆ 一级市场

- 国债方面，上周三财政部发行 28 天和 63 天期贴现国债，2 年和 5 年期付息国债；上周五财政部发行 91 天和 182 天期贴现国债，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 个月期、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 年和 10 年期固息债。上周五国开行招标发行 5 年期固息债；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，收益率小幅上行。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上行 4BP 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上行 3BP 至 5BP；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	1.81	4	3
6 月期	1.81	5	4
9 月期	1.78	5	4
1 年期	1.76	5	4
3 年期	1.78	5	4
4 年期	1.82	5	3
5 年期	1.87	5	3
7 年期	1.97	5	4
10 年期	2.06	5	4
3 月 Shibor (ACT/360)			
6 月期	1.88	3	3
9 月期	1.86	4	3
1 年期	1.84	4	4
2 年期	1.82	3	3
3 年期	1.84	4	3
4 年期	1.89	5	4
5 年期	1.94	5	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

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 64 支，规模合计 554.50 亿元；
短期融资券 12 支，规模合计 84.56 亿元；中期票据 144 支，规模合计 1428.48 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限震荡-16BP 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 华电江苏 SCP012	1.9000	47D	10.0000	AAA	-
24 航天电子 SCP007	1.9500	49D	14.2000	AA+	-
24 宁沪高 SCP014	1.8600	51D	5.6500	AAA	-
24 沪电力 SCP015	1.8700	72D	26.0000	AAA	-
24 华能 SCP008	1.8300	85D	50.0000	AAA	-
24 吉林电力 SCP003	1.9200	86D	11.0000	AAA	-
24 太原钢铁 SCP001 (科创票据)	1.9000	90D	15.0000	AAA	-
24 南通沿海 SCP007	1.9300	90D	10.0000	AAA	-
24 华锦化工 SCP001	1.9400	90D	7.0000	AAA	-
24 江苏高科 SCP001	1.9100	90D	5.0000	AAA	-
24 苏州高技 SCP010	1.9300	110D	3.0000	AAA	-
24 苏州高技 SCP009	1.9200	111D	3.0000	AAA	-
24 苏州高技 SCP008	1.9300	112D	3.0000	AAA	-
24 苏州高技 SCP007	1.9500	113D	3.0000	AAA	-
24 凯盛科技 SCP009	1.9500	114D	10.0000	AAA	-
24 苏沙钢 SCP004 (科创票据)	1.8900	119D	8.0000	AAA	-
24 浪潮电子 SCP006 (科创票据)	1.9500	120D	10.0000	AAA	-
24 华为 SCP004	1.6000	130D	40.0000	AAA	-
24 日照港 SCP002	1.9700	130D	13.0000	AAA	-
24 象屿股份 SCP006	2.0000	136D	15.0000	AAA	-
24 大唐租赁 SCP005	1.9100	164D	5.0000	AAA	-
24 远东租赁 SCP009	2.0200	168D	10.0000	AAA	-
24 大唐资本 SCP005	1.9600	168D	10.0000	AAA	-
24 豫园商城 SCP004	3.9300	170D	3.0000	AAA	-
24 益航资产 SCP002	1.9500	180D	5.0000	AAA	-
24 珠海港 SCP006	1.9600	210D	5.0000	AAA	-
24 苏州高新 SCP041	1.9400	211D	3.0000	AAA	-
24 深圳资本 SCP001	1.9500	225D	18.0000	AAA	-
24 浙江旅投 SCP002	2.0000	225D	5.0000	AA+	-
24 苏州高新 SCP040	1.9500	226D	2.0000	AAA	-

24 中航租赁 SCP006	1.9200	240D	10.0000	AAA	-
24 宜昌城发 SCP004	1.9900	240D	5.0000	AA+	-
24 龙岩投资 SCP003	2.0000	240D	3.0000	AA	-
24 深圳资本 SCP002	1.9600	244D	10.0000	AAA	-
24 华友钴业 SCP004(科创票据)	2.4500	256D	6.0000	AA+	-
24 龙盛 SCP012(科创票据)	2.0300	260D	10.0000	AAA	-
24 沪国际 SCP002	1.9400	262D	10.0000	AAA	-
24 中关租赁 SCP002	2.0400	262D	5.0000	AA+	-
24 首钢 SCP004	1.9500	265D	20.0000	AAA	-
24 广州高新 SCP005	1.9800	265D	10.0000	AAA	-
24 烟台蓝天 SCP003	1.9500	265D	5.0000	AAA	-
24 浦发集团 SCP005	1.8900	266D	10.0000	AAA	-
24 环球租赁 SCP010	1.9800	266D	5.0000	AAA	-
24 桐昆 SCP011(科创票据)	2.0100	266D	5.0000	AA+	-
24 海宁资产 SCP002	1.9500	266D	4.1000	AA+	-
24 浦发集团 SCP004	1.9300	267D	10.0000	AAA	-
24 西安高新 SCP001	1.9800	267D	5.0000	AAA	-
24 浙交投 SCP013	1.9100	268D	10.0000	AAA	-
24 深业 SCP001	1.9800	270D	20.0000	AAA	-
24 甬城投 SCP001	1.9500	270D	10.0000	AAA	-
24 昆山国创 SCP003	1.9800	270D	10.0000	AA+	-
24 桂铁投 SCP002	1.9200	270D	7.9000	AAA	-
24 吴江交投 SCP001	2.0000	270D	7.8000	AA+	-
24 伊犁财通 SCP004	2.0100	270D	5.0000	AA+	-
24 温州交通 SCP001	1.9800	270D	5.0000	AA+	-
24 宁波建工 SCP002	2.0000	270D	4.0000	AA	-
24 乌交旅 SCP003	1.9800	270D	3.0000	AA+	-
24 苏州燃气 SCP001	1.9900	270D	3.0000	AA+	-
24 宁夏农垦 SCP005	2.0500	270D	2.0000	AA+	-
24 广西林业 SCP004	2.5000	270D	2.0000	AA	-
24 徐州交通 SCP001	2.0000	270D	1.2200	AAA	-
24 扬城建 SCP002	1.9500	270D	1.0300	AAA	-
24 吴中城投 SCP005	1.9900	270D	1.0000	AA+	-
24 创鸿资产 SCP001	1.9700	270D	0.6000	AA+	-
短期融资券	发行利率	发行期限	发行规模	主体评级 债券评级	
	(%)	(天)	(亿元)		
24 平顶发展 CP002	1.9500	120D	3.6000	AA+	-
24 苏州资产 CP003	1.8700	130D	2.0000	AAA	-
24 浙交投 CP001	1.9000	365D	20.0000	AAA	-
24 桂交投 CP005	1.9700	365D	15.0000	AAA	-
24 平安租赁 CP004	2.0300	365D	12.0000	AAA	-
24 徐州交通 CP001	1.9900	365D	6.0000	AAA	-

24 鹰潭国控 CP001	2.0100	365D	5.9600	AA+	-
24 恒力 CP004	2.4500	365D	5.0000	AAA	-
24 潞川国资 CP002	1.9700	365D	5.0000	AA+	-
24 高淳国资 CP003	2.0000	365D	5.0000	AA+	-
24 晋中公用 CP002	1.9800	365D	3.0000	AA+	-
24 靖江北辰 CP003	2.1200	365D	2.0000	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 昆明城建 MTN004	2.5400	1.3342	6.1000	AA+	-
24 滨江房产 MTN003	3.9000	2.0000	6.0000	AAA	-
24 保利久联 MTN001	2.5000	2.0000	3.0000	AA+	-
24 淮南矿 MTN001	2.0800	2.9973	15.0000	AAA	-
24 光明 MTN003	1.9600	3.0000	30.0000	AAA	-
24 大唐集 MTN006	2.0400	3.0000	30.0000	AAA	AAA
24 豫交投 MTN007	2.0800	3.0000	25.0000	AAA	AAA
24 中广核 MTN002(科创票据)	1.8600	3.0000	20.0000	AAA	-
24 厦国贸控 MTN011	2.4000	3.0000	15.0000	AAA	AAA
24 武进经发 MTN005	2.0900	3.0000	15.0000	AA+	-
24 建安投资 MTN003	2.1300	3.0000	13.8000	AA+	-
24 上海华谊 MTN001A	2.0300	3.0000	10.0000	AAA	-
24 赣金控 MTN004	2.0600	3.0000	10.0000	AAA	AAA
24 首都机场 MTN003	1.9500	3.0000	10.0000	AAA	-
24 甘国投 MTN005	2.1400	3.0000	10.0000	AAA	-
24 乌江水电 GN001	2.2000	3.0000	10.0000	AAA	AAA
24 海尔金盈 MTN004	2.1600	3.0000	10.0000	AAA	-
24 闽投 MTN006	2.0300	3.0000	10.0000	AAA	-
24 首都机场 MTN002A	1.9400	3.0000	10.0000	AAA	-
24 湘高速 MTN010	2.0900	3.0000	10.0000	AAA	-
24 佛山建设 MTN002	2.0700	3.0000	10.0000	AA+	-
24 鲁宏桥 MTN009(科创票据)	2.8000	3.0000	10.0000	AA+	AA+
24 辽成大 MTN001	3.9400	3.0000	10.0000	AA+	AA+
24 南浦口 MTN003	2.1100	3.0000	10.0000	AA+	-
24 盐城城南 MTN003	2.1400	3.0000	10.0000	AA+	-
24 光明房产 MTN005	2.5500	3.0000	6.0000	AA+	-
24 南京软件 MTN001	2.2900	3.0000	6.0000	AA	-
24 昆明安居 MTN001	2.6900	3.0000	5.3000	AA+	-
24 辽港集团 MTN002A	2.0500	3.0000	5.0000	AAA	-
24 康富租赁 MTN003(碳中和债)	2.4500	3.0000	5.0000	AAA	-
24 平安租赁 MTN010	2.2200	3.0000	5.0000	AAA	-
24 华能水电 GN003A(科创票据)	2.0600	3.0000	5.0000	AAA	-
24 温州交通 MTN003	2.0900	3.0000	5.0000	AA+	-
24 台州金融 MTN001	2.0700	3.0000	5.0000	AA+	-

24 如皋交通 MTN001	2.0000	3.0000	5.0000	AA+	-
24 太仓资产 MTN003	2.0000	3.0000	5.0000	AA+	-
24 中南勘测 MTN001(科创票据)	2.1900	3.0000	5.0000	AA+	AA+
24 中国水务 MTN001BC(绿色)	3.0000	3.0000	5.0000	AA+	AA+
24 靖江滨江 MTN001	2.2500	3.0000	5.0000	AA	-
24 成都公交 GN002	2.1000	3.0000	4.3000	AA+	-
24 瀚瑞投资 MTN004	2.2000	3.0000	3.5000	AA+	-
24 景德城投 MTN002	2.2700	3.0000	3.0000	AA	-
24 华立 MTN001	2.8600	3.0000	2.0000	AA+	-
24 苏州高新 MTN007A	1.9600	3.0000	1.0000	AAA	-
24 淮安经开 MTN003	2.2100	3.0000	1.0000	AA+	-
24 芜湖宜居 MTN002	2.0800	3.0000	0.8800	AA+	-
24 中石集 MTN002	2.0000	5.0000	55.0000	AAA	-
24 中石集 MTN001	2.0000	5.0000	55.0000	AAA	-
24 中冶 MTN006	2.2500	5.0000	20.0000	AAA	AAA
24 华润电力 MTN001	2.1500	5.0000	20.0000	AAA	AAA
24 乌城投 MTN005	2.1700	5.0000	20.0000	AAA	-
24 泸州窖 MTN004	2.1000	5.0000	20.0000	AAA	-
24 云能投 MTN017	2.3500	5.0000	20.0000	AAA	-
24 泰安城投 MTN001	2.4200	5.0000	20.0000	AA+	-
24 泸州发展 MTN002	2.4000	5.0000	18.0000	AA+	-
24 厦国贸控 MTN012	2.3300	5.0000	15.0000	AAA	-
24 新兴际华 MTN004	2.1500	5.0000	15.0000	AAA	-
24 华发实业 MTN002	2.5500	5.0000	15.0000	AAA	AAA
24 成都高新 MTN003	2.2100	5.0000	15.0000	AAA	AAA
24 海螺环保 GN001	2.1300	5.0000	15.0000	AA+	AA+
24 济南轨交 MTN001	2.2100	5.0000	14.0000	AAA	-
24 广州工控 MTN002	2.1700	5.0000	12.0000	AAA	-
24 苏科技城 MTN001	2.3500	5.0000	12.0000	AA	-
24 湖交投 MTN003	2.0500	5.0000	10.0000	AAA	-
24 鄂交投 MTN003	2.2700	5.0000	10.0000	AAA	-
24 中建材集 MTN001A(科创票据)	2.0700	5.0000	10.0000	AAA	-
24 豫航空港 MTN015	2.4900	5.0000	10.0000	AAA	-
24 上海华谊 MTN001B	2.2400	5.0000	10.0000	AAA	-
24 贵州高速 MTN007	2.2600	5.0000	10.0000	AAA	-
24 广州资管 MTN003	2.1500	5.0000	10.0000	AAA	-
24 海发国资 MTN004	2.3400	5.0000	10.0000	AAA	-
24 乌江能源 MTN001	2.2800	5.0000	10.0000	AAA	AAA
24 华能水电 GN003B(科创票据)	2.1700	5.0000	10.0000	AAA	-
24 云建投 MTN014	2.5700	5.0000	10.0000	AAA	-
24 连云城建 MTN002	2.2900	5.0000	10.0000	AA+	-
24 南京医药 MTN002	2.3000	5.0000	10.0000	AA+	-

24 津海泰 MTN001	2.8000	5.0000	10.0000	AA+	-
24 金华融盛 MTN003	2.3300	5.0000	10.0000	AA	-
24 重庆开投 MTN002	2.3000	5.0000	9.0000	AA+	-
24 金桥开发 MTN001	2.2200	5.0000	8.0000	AAA	-
24 粤珠江 MTN006	2.4000	5.0000	8.0000	AAA	-
24 晶合集成 MTN001(科创票据)	1.9000	5.0000	8.0000	AAA	-
24 中金岭南 MTN004	2.2900	5.0000	8.0000	AA+	-
24 城发投资 MTN004	2.5500	5.0000	8.0000	AA+	-
24 淮安投资 MTN001	2.1800	5.0000	8.0000	AA+	-
24 德源投资 MTN002	2.3900	5.0000	7.0000	AA+	-
24 首旅 MTN013A	2.2200	5.0000	6.0000	AAA	AAA
24 天津轨交 MTN006	2.2700	5.0000	6.0000	AAA	-
24 赣建工 MTN001A	2.7000	5.0000	6.0000	AA+	-
24 华山旅游 MTN001	2.5800	5.0000	6.0000	AA	-
24 潼南城投 MTN001	2.7000	5.0000	5.5000	AA	-
24 卓越商业 MTN001	3.0000	5.0000	5.3000	AAA	-
24 广新控股 MTN002A	2.1000	5.0000	5.0000	AAA	AAA
24 辽港集团 MTN002B	2.1500	5.0000	5.0000	AAA	-
24 首创集 MTN005A	2.1900	5.0000	5.0000	AAA	-
24 成都环境 MTN002	2.1900	5.0000	5.0000	AAA	AAA
24 绍兴交投 MTN001	1.9900	5.0000	5.0000	AAA	-
24 津能源 MTN001	2.2600	5.0000	5.0000	AAA	AAA
24 皖农垦 MTN002(乡村振兴)	2.1000	5.0000	5.0000	AA+	-
24 济南金投 MTN001	2.3000	5.0000	5.0000	AA+	-
24 天津医药 MTN001	2.5500	5.0000	5.0000	AA+	AA+
24 北辰科技 MTN004	2.5500	5.0000	5.0000	AA+	-
24 济宁能源 MTN001	2.7000	5.0000	5.0000	AA+	AA+
24 金坛国发 MTN001	2.2500	5.0000	5.0000	AA+	-
24 高淳建设 MTN003	2.3000	5.0000	5.0000	AA	-
24 太仓水务 MTN002	2.2000	5.0000	5.0000	AA	-
24 润企投资 MTN002	2.3700	5.0000	4.5000	AA	-
24 闽漳龙 MTN004	2.2400	5.0000	4.0000	AAA	AAA
24 宁夏国资 MTN001	2.2200	5.0000	4.0000	AAA	-
24 武汉国投 MTN003A	2.2200	5.0000	4.0000	AAA	AAA
24 蔚然投资 MTN001(科创票据)	2.1800	5.0000	4.0000	AA+	-
24 赣建工 MTN001B	2.9900	5.0000	4.0000	AA+	-
24 海恒控股 MTN003A	2.1700	5.0000	4.0000	AA+	-
24 高淳经开 MTN007	2.3800	5.0000	3.0000	AA	-
24 九龙园 MTN002	2.4700	5.0000	2.1000	AA	-
24 青岛黄岛 MTN003B	2.3800	5.0000	2.0000	AA+	-
24 漳州资本 MTN002	2.2000	5.0000	2.0000	AA+	-
24 海恒控股 MTN003B	1.9200	5.0000	2.0000	AA+	-

24 苏州高新 MTN007B	2.2000	5.0000	1.0000	AAA	-
24 青岛黄岛 MTN003A	2.1900	5.0000	1.0000	AA+	-
24 津城建 MTN030	2.4700	7.0000	10.0000	AAA	-
24 中铁建 MTN001	2.2800	10.0000	30.0000	AAA	AAA
24 晋能煤业 MTN011	2.3400	10.0000	20.0000	AAA	-
24 中铝集 MTN004	2.3400	10.0000	20.0000	AAA	-
24 华能 MTN007	2.2600	10.0000	15.0000	AAA	AAA
24 云南交投 MTN003	2.5700	10.0000	15.0000	AAA	-
24 桂投资 MTN007	2.5500	10.0000	15.0000	AAA	-
24 福州城投 MTN002	2.3400	10.0000	13.0000	AAA	-
24 中建材集 MTN001B(科创票据)	2.3700	10.0000	10.0000	AAA	-
24 首创集 MTN005B	2.4400	10.0000	10.0000	AAA	-
24 鄂联投 MTN007	2.4700	10.0000	10.0000	AAA	AAA
24 首都机场 MTN002B	2.3000	10.0000	10.0000	AAA	-
24 鲁能源 MTN002A	2.3600	10.0000	10.0000	AAA	AAA
24 武汉国投 MTN003B	2.5000	10.0000	6.0000	AAA	AAA
24 兴城投资 MTN002	2.3500	10.0000	5.0000	AAA	AAA
24 广新控股 MTN002B	2.4100	10.0000	5.0000	AAA	AAA
24 潍坊投资 MTN005	3.0000	10.0000	5.0000	AA+	-
24 首旅 MTN013B	2.4000	10.0000	4.0000	AAA	AAA
24 皖国资 MTN001(科创票据)	2.3600	10.0000	4.0000	AAA	AAA
24 福州新发 MTN004	2.4400	10.0000	3.2000	AAA	-
24 深圳地铁 MTN005	2.3800	15.0000	25.0000	AAA	AAA
24 鲁能源 MTN002B	2.4500	15.0000	15.0000	AAA	AAA
24 洪市政 MTN006	2.5000	15.0000	10.0000	AAA	AAA
24 中化股 MTN004	2.5800	30.0000	30.0000	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1.90%；6个月品种收益率较前周上行3BP，上周收于1.92%；1年期品种收益率较前周上行1BP，上周收于1.93%。
- 中期票据方面，收益率震荡上行。AAA级中期票据中，3年期品种收益率较前周上行5BP，上周收于2.14%；5年期

品种收益率较前周上行 4BP，上周收于 2.26%。

- 企业债方面，收益率震荡上行。AAA 级企业债中，3 年期品种收益率较前周上行 5BP，上周收于 2.03%；5 年期品种收益率较前周上行 4BP，上周收于 2.12%；10 年期品种收益率较前周上行 5BP，上周收于 2.32%。

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 15.0BP，上周收于 3.940%。
- 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 2.225%。

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	4.053	17.3	-20.4	-19.7
5 年	3.796	17.9	-11.7	-5.1
10 年	3.940	15.0	-9.0	6.1
30 年	4.219	11.2	-8.4	19.1
德国国债				
2 年	2.386	3.4	-14.5	-1.8
5 年	2.132	5.4	-10.0	18.4
10 年	2.225	5.1	-7.9	20.1
30 年	2.458	4.2	-5.6	19.5

数据来源：Bloomberg

◆ 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 39.52BP，上周收于 3.3570%。

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	3.8615	17.07	-24.60	-20.42
10 年	3.4925	13.55	-11.05	1.85
30 年	3.3910	8.92	-11.60	7.49

数据来源: Bloomberg

六、贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周下跌 0.51%，上周最高 2458.60 美元/盎司、最低 2364.19 美元/盎司，收于 2430.93 美元/盎司。
- 白银价格较前周下跌 3.87%，上周最高 28.67 美元/盎司、最低 26.42 美元/盎司，收于 27.44 美元/盎司。
- 铂金价格较前周下跌 3.73%，上周最高 960.05 美元/盎司、最低 904.66 美元/盎司，收于 922.16 美元/盎司。
- 钯金价格较前周上涨 1.73%，上周最高 933.00 美元/盎司、最低 826.00 美元/盎司，收于 905.20 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	2430.93	-0.51%	-0.70%
白银	27.44	-3.87%	-5.50%
铂金	922.16	-3.73%	-5.53%
钯金	905.20	1.73%	-2.17%

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 3.83%，上周最高 77.09 美元/桶、最低 71.67 美元/桶，收于 76.98 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 2.45%，上周最

高 79.83 美元/桶、最低 75.05 美元/桶，收于 79.46 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	76.98	3.83%	-2.11%
ICE Brent 主力合约	79.46	2.45%	-2.52%

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 2.82%，上周最高 8923.00 美元/吨、最低 8750.50 美元/吨，收于 8831.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周上涨 1.41%，上周最高 2301.00 美元/吨、最低 2262.00 美元/吨，收于 2295.00 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	8831.00	-2.82%	-4.43%
LME 3 月铝	2295.00	1.41%	-0.86%

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 2.67%，上周最高 1042.00 美分/蒲式耳、最低 1001.25 美分/蒲式耳，收于 1001.50 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)	542.00	0.32%	2.80%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1001.50	-2.67%	-2.15%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	395.25	-2.11%	-1.19%
ICE 棉花(美分/磅)	68.38	0.07%	-0.74%
ICE 白糖(美分/磅)	18.54	2.04%	-2.52%

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上涨 9.25%，上周最高 2.187 美元/百万英热单位、最低 1.882 美元/百万英热单位，收于 2.161 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	2.161	9.25%	5.88%

数据来源: Refinitiv