

工银市场周报 (8月12日-8月16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8月19日

2024年第33期 总第584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 7.1464,较前周贬值约 0.02%;银行间市场人民币汇率较前周升值约 0.09%,上周收于 7.1680;1 年期掉期点较前周上行 40 个点,上周收于-2395。	
◆1 年期境外美元对人民币无本金交割远期(NDF)较前周下行 150 个点,上周收于 6.9810。	
二、外币汇率市场上周概览	2
◆美元指数较前周下跌 0.65%,上周收于 102.463。	
◆欧元兑美元较前周上涨 1.03%,上周收于 1.1028。	
◆美元兑日元较前周上涨 0.66%,上周收于 147.58。	
◆澳元兑美元较前周上涨 1.43%,上周收于 0.6666。	
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 1.70%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 1.86%。	
◆二级市场:10 年期国债收益率较前周下行 2BP,上周收于 2.17%;5 年期国开债收益率较前周上行 4BP,上周收于 2.01%。	
◆一级市场:财政部招标发行 1 年期、3 年期、7 年期、20 年期付息国债,以及 91 天期贴现国债。农发行招标发行 91 天、1 年、2 年、3 年、5 年、7 年、10 年和 30 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、7 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 63 支,规模合计 567.49 亿元;短期融资券 9 支,规模合计 74.06 亿元;中期票据 94 支,规模合计 1110.96 亿元。	
◆二级市场:短期融资券、中期票据和企业债收益率均上行。	
五、外币利率市场上周概览	11
◆美国国债价格上涨,10 年期美国国债收益率较前周下行 5.7BP,上周收于 3.883%。	
◆德国国债价格下跌,10 年期德国国债收益率较前周上行 2.2BP,上周收于 2.247%。	
六、贵金属市场上周概览	12
◆黄金价格较前周上涨 3.14%,上周收于 2507.28 美元/盎司。	
◆白银价格较前周上涨 5.71%,上周收于 29.01 美元/盎司。	
◆铂金价格较前周上涨 3.50%,上周收于 954.44 美元/盎司。	
◆钯金价格较前周上涨 5.05%,上周收于 950.93 美元/盎司。	
七、原油市场上周概览	12
◆WTI 原油期货主力合约价格较前周下跌 0.28%,上周收于 75.49 美元/桶。	
◆BRENT 原油期货主力合约价格较前周上涨 0.15%,上周收于 79.58 美元/桶。	
八、基本金属市场上周概览	13
◆LME3 月期铜价格较前周上涨 3.92%,上周收于 9177.50 美元/吨。	
九、农产品市场上周概览	13
◆CBOT 大豆期货主力合约价格较前周下跌 4.62%,上周收于 955.25 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 1.48%,上周收于 2.129 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（8月16日）报 7.1464，较前周贬值约 0.02%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 0.09%，上周最高 7.1320、最低 7.1971，收于 7.1680，波幅为 0.91%。
- 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 40 个点，上周最高-2345、最低-2434，收于 -2395，波幅为 3.72%。
- 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 150 个点，上周最高 7.0175、最低 6.9270，收于 6.9810，波幅为 1.30%。

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	-	-	7.1464	15	118	637
银行间市场汇价	7.1971	7.1320	7.1680	-66	-581	760
掉期点						
1 个月期限	-246	-285	-252	4	16	-44
2 个月期限	-485	-506	-501	16	65	-78
3 个月期限	-721	-748	-733	18	49	-98
6 个月期限	-1372	-1433	-1394	11	143	-146
1 年期限	-2345	-2434	-2395	40	483	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	7.1530	7.0860	7.1200	-100	465	-228

2 个月期限	7.1375	7.0740	7.1045	-105	420	-134
3 个月期限	7.1220	7.0565	7.0870	-120	380	-77
6 个月期限	7.0800	7.0110	7.0425	-155	310	139
1 年期限	7.0175	6.9270	6.9810	-150	325	525

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 0.65%，上周最高 103.310、最低 102.270，收于 102.463。
- 欧元兑美元较前周上涨 1.03%，上周最高 1.1047、最低 1.0910，收于 1.1028。
- 美元兑日元较前周上涨 0.66%，上周最高 149.39、最低 146.07，收于 147.58。
- 澳元兑美元较前周上涨 1.43%，上周最高 0.6671、最低 0.6563，收于 0.6666。

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	102.463	-0.65%	-1.57%
欧元/美元	1.1028	1.03%	1.88%
美元/日元	147.58	0.66%	-1.60%
澳元/美元	0.6666	1.43%	1.93%

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 1.70% 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 1.86%。央行公开市场方面，上周一（8 月 12 日）进行逆回购操作 745 亿元，逆回购到期 6.7 亿元；上周二（8 月 13 日）进行逆回购操作 3857 亿元，逆回购到期 6.2 亿元；上周三（8 月 14 日）进行逆回购操作 3692 亿元，无逆回购到期；上周四（8 月 15 日）进行逆回购操作 5777 亿元，逆回购到期 71 亿元和 MLF 到期 4010 亿元；上周五进行逆回购操作 1378 亿元，逆回购到期 129 亿元。本周（8 月 19 日-8 月 23 日）将有逆回购到期 14928 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)	1.70	-8	-8
7 天 Shibor (1W)	1.81	2	4
3 月期 Shibor (3M)	1.84	0	-2
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.80	-8	-20
7 天回购定盘利率 (FR007)	1.86	0	-4

数据来源：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上行 8BP，上周收于 1.53%；5 年期国债收益率较前周上行 3BP，上周收于 1.89%；10 年期国债收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.17%。
- 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上行 3BP，上周收于 1.69%；5 年期国开债收益率较前周上行 4BP，上周收于 2.01%；10 年期国开债收益率

较前周下行 1BP，上周收于 2.25%。

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	8	11
3 年期	1.72	5	3
5 年期	1.89	3	6
7 年期	2.08	2	10
10 年期	2.17	-2	2

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	1.69	3	3
3 年期	1.90	5	7
5 年期	2.01	4	7
7 年期	2.11	4	5
10 年期	2.25	-1	1

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 1 年、3 年、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。
- 政策性金融债方面，上周一农发行招标发行 91 天、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；进出口行招标发行 7 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、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 -2BP 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 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	1.84	3	6
6 月期	1.83	2	6
9 月期	1.79	1	5
1 年期	1.76	0	4
3 年期	1.76	-2	2
4 年期	1.80	-2	1
5 年期	1.84	-3	0
7 年期	1.96	-1	3
10 年期	2.05	-1	3
3 月 Shibor（ACT/360）			
6 月期	1.92	4	7
9 月期	1.87	1	4
1 年期	1.84	0	4
2 年期	1.81	-1	2
3 年期	1.82	-2	1
4 年期	1.86	-3	1
5 年期	1.91	-3	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

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 63 支，规模合计 567.49 亿元；短期融资券 9 支，规模合计 74.06 亿元；中期票据 94 支，规模合计 1110.96 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限震荡区间-13BP 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	债券评级
24 珠海港股 SCP004	2.0200	73D	4.0000	AA+	—
24 夏商 SCP013	1.9900	74D	5.0000	AA+	—
24 招商公路 SCP002	1.9000	90D	15.0000	AAA	—
24 江北新区 SCP001	1.9900	90D	8.0000	AAA	—
24 江苏广电 SCP010(科创票据)	1.9800	90D	5.0000	AAA	—
24 华能 SCP009	1.9500	92D	45.0000	AAA	—
24 皖交控 SCP003	1.8600	92D	10.0000	AAA	—
24 沪电力 SCP016	1.9700	93D	17.0000	AAA	—
24 楚天智能 SCP004	1.9400	100D	8.0000	AA+	—
24 中电路桥 SCP011	2.0200	105D	12.0000	AAA	—
24 红豆 SCP002(科创票据)	5.0000	120D	5.0000	AA+	—
24 浪潮电子 SCP007(科创票据)	2.0500	121D	10.0000	AAA	—
24 天山材料 SCP001	2.0100	137D	10.0000	AAA	—
24 中交一公 SCP005	1.9500	141D	20.0000	AAA	—
24 天成租赁 SCP007	2.0300	147D	10.0000	AAA	—
24 苏广播 SCP002	1.9800	156D	12.0000	AAA	—
24 苏州高新 SCP042	2.0000	156D	2.0000	AAA	—
24 申能股 SCP003	1.9300	180D	15.0000	AAA	—
24 宁国建投 SCP002	2.1300	185D	3.3500	AA	—
24 沪机场股 SCP005	1.9700	190D	10.0000	AAA	—
24 沪机场股 SCP006	1.9700	190D	10.0000	AAA	—

24 上海机场 SCP010	1.9500	190D	10.0000	AAA	—
24 沪百联 SCP002	1.9900	191D	25.0000	AAA	—
24 海诺投资 SCP002	2.0500	210D	5.0000	AA+	—
24 鲁商 SCP006	2.4500	210D	5.0000	AA+	—
24 苏州高新 SCP043	2.0000	219D	3.0000	AAA	—
24 湖北宏泰 SCP002	2.0700	238D	15.0000	AAA	—
24 越秀租赁 SCP005	2.0800	240D	6.0000	AAA	—
24 鲁钢铁 SCP010	2.0500	246D	10.0000	AAA	—
24 茅台租赁 SCP002	1.9900	249D	5.0000	AAA	—
24 南昌轨道 SCP004	2.0300	250D	5.5000	AAA	—
24 平安租赁 SCP012	2.1000	254D	13.0000	AAA	—
24 海淀国资 SCP004	2.1100	260D	20.0000	AAA	—
24 鲁钢铁 SCP009	1.9900	261D	15.0000	AAA	—
24 淮南矿 SCP005	2.0300	267D	10.0000	AAA	—
24 中铝资本 SCP003	2.0800	267D	5.0000	AAA	—
24 广核电力 SCP003	1.9700	268D	10.0000	AAA	—
24 海格通信 SCP001	1.9900	268D	7.0000	AAA	—
24 海宁资产 SCP003	2.0800	269D	4.0000	AA+	—
24 广州产投 SCP001	2.0000	270D	13.0000	AAA	—
24 南昌交投 SCP004	2.0300	270D	10.0000	AAA	—
24 津保投 SCP012	2.1300	270D	10.0000	AAA	—
24 广州发展 SCP003	2.0100	270D	10.0000	AAA	—
24 石交投集 SCP001	2.1000	270D	10.0000	AAA	—
24 津渤海 SCP010	2.3300	270D	10.0000	AAA	—
24 津保投 SCP013	2.0700	270D	10.0000	AAA	—
24 周口城投 SCP001	2.0900	270D	10.0000	AA+	—
24 赣州城投 SCP002	2.1500	270D	10.0000	AA+	—
24 莆田国资 SCP003	2.0800	270D	10.0000	AA	—
24 泉州交通 SCP004	1.9500	270D	5.0000	AAA	—
24 甘金控 SCP003	2.1000	270D	5.0000	AAA	—
24 甘国投 SCP005	2.0000	270D	5.0000	AAA	—
24 豫能控 SCP003(乡村振兴)	2.0800	270D	5.0000	AA+	—
24 牧原食品 SCP001	2.5000	270D	5.0000	AA+	—
24 国投租赁 SCP002	1.9400	270D	5.0000	AA+	—
24 景德镇陶 SCP002	2.0900	270D	5.0000	AA+	—
24 徐州交通 SCP002	2.0200	270D	4.0000	AAA	—
24 崇川国资 SCP001	2.0300	270D	3.4500	AA+	—
24 千信集团 SCP001	3.2000	270D	3.0000	AA+	—
24 英特集团 SCP002	2.1000	270D	3.0000	AA+	—
24 东阳光 SCP006	5.8000	270D	2.3000	AA+	—
24 易鑫租赁 SCP003	2.6000	270D	2.0000	AA+	—
24 兴化城投 SCP005	2.1500	270D	1.8900	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	债券评级
24 保利发展 CP003	2.0200	90D	25.0000	AAA	—
24 浦口交通 CP002	2.0900	120D	5.0000	AA	—
24 淮安淮安 CP003	2.1100	270D	1.3600	AA	—
24 青岛上合 CP003	2.1100	365D	10.0000	AAA	—
24 海通恒信 CP002	1.9900	365D	10.0000	AAA	—
24 徐州交通 CP002	2.0200	365D	9.0000	AAA	—
24 恒逸 CP005	4.2700	365D	7.0000	AA+	A-1
24 萧山国资 CP001	1.9900	365D	5.0000	AAA	—
24 西青经开 CP001	2.1200	365D	1.7000	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 甘肃建设 MTN001	3.2000	2.0000	1.3000	AAA	—
24 姜堰经开 MTN001	2.2500	2.0000	0.5000	AA	—
24 汇金 MTN004(增发 2)	2.0800	3.0000	90.0000	AAA	—
24 吉利 MTN003(科创票据)	2.2000	3.0000	20.0000	AAA	—
24 国电 GN002(革命老区)	1.9500	3.0000	19.6000	AAA	—
24 五矿集 MTN002A	2.2400	3.0000	16.0000	AAA	—
24 中交房产 MTN001	2.6200	3.0000	13.7000	AAA	AAA
24 华电股 MTN005	2.0700	3.0000	13.0000	AAA	—
24 中建三局 MTN001	2.2000	3.0000	13.0000	AAA	—
24 先行控股 MTN004	2.0800	3.0000	11.7000	AA+	—
24 浙能源 MTN003	2.0800	3.0000	10.0000	AAA	—
24 辽港集团 MTN003	2.1500	3.0000	10.0000	AAA	—
24 上海电气 MTN001	2.2000	3.0000	10.0000	AAA	—
24 华电股 MTN004A	2.0500	3.0000	10.0000	AAA	—
24 南京浦口 MTN006	2.1600	3.0000	8.0000	AA+	—
24 招商平安 MTN002	2.0500	3.0000	5.0000	AAA	AAA
24 冀中能源 MTN014A(科创票据)	2.6000	3.0000	5.0000	AAA	—
24 嘉秀发展 MTN001	2.3300	3.0000	5.0000	AA+	—
24 淮安新城 MTN008	2.2000	3.0000	5.0000	AA+	—
24 龙岩文旅 MTN003	2.1400	3.0000	5.0000	AA+	—
24 融汇财富 MTN001A	2.3000	3.0000	5.0000	AA+	—
24 中兴国资 MTN004	2.2000	3.0000	5.0000	AA+	—
24 河北国控 MTN001	2.6500	3.0000	5.0000	AA+	—
24 甬工投 MTN001	2.1400	3.0000	5.0000	AA+	—
24 扬子江投 MTN002	2.5500	3.0000	5.0000	AA	—
24 温州交运 MTN003	2.2500	3.0000	2.0000	AA	—
24 怀化高新 MTN002	2.5700	3.0000	1.0400	AA	—
24 云投 MTN011	2.8100	4.0000	8.0000	AAA	—
24 汇金 MTN005(增发 1)	2.0700	5.0000	150.0000	AAA	—

24 邮政 MTN004	2.1400	5.0000	30.0000	AAA	—
24 大唐集 MTN007	2.2800	5.0000	30.0000	AAA	AAA
24 湘高速 MTN011	2.1100	5.0000	30.0000	AAA	—
24 中电投 MTN015	2.0900	5.0000	20.0000	AAA	—
24 陕延油 MTN011	2.2800	5.0000	20.0000	AAA	AAA
24 晋江城投 MTN001	2.3900	5.0000	18.0000	AA+	—
24 中电投 MTN016	2.3000	5.0000	17.0000	AAA	—
24 华发集团 MTN013	2.6800	5.0000	15.0000	AAA	AAA
24 鲁能源 GN003(碳中和债)	2.2700	5.0000	10.0000	AAA	—
24 九龙江 MTN002	2.4300	5.0000	10.0000	AAA	AAA
24 悦达 MTN003	2.6900	5.0000	10.0000	AAA	AAA
24 山东金融 MTN001	2.1900	5.0000	10.0000	AAA	—
24 五矿集 MTN002B	2.3300	5.0000	10.0000	AAA	—
24 华电股 MTN004B	2.1700	5.0000	10.0000	AAA	—
24 景国资 MTN003	2.7900	5.0000	10.0000	AA+	—
24 克拉玛依 MTN002	2.3500	5.0000	10.0000	AA+	—
24 昌吉州 MTN002	2.3900	5.0000	10.0000	AA+	—
24 丁字湾 MTN003	2.9000	5.0000	10.0000	AA	—
24 武清国资 MTN004	2.7400	5.0000	9.6000	AA+	—
24 上虞国投 MTN002	2.2300	5.0000	9.3000	AA+	—
24 株国投 MTN005	2.5000	5.0000	9.0000	AA+	—
24 潍坊城建 MTN006	2.8300	5.0000	7.0000	AAA	—
24 粤珠江 MTN007	2.4400	5.0000	7.0000	AAA	—
24 徐工集团 MTN002(科创票据)	2.1200	5.0000	6.0000	AAA	—
24 天津轨交 MTN007	2.4300	5.0000	6.0000	AAA	—
24 堰岷江 MTN001	2.6200	5.0000	6.0000	AA	AAA
24 重庆开投 MTN003	2.4800	5.0000	5.5000	AA+	—
24 如皋经贸 MTN005	2.3500	5.0000	5.2000	AA+	—
24 中兴通讯 MTN001(科创票据)	2.2500	5.0000	5.0000	AAA	—
24 泰州国控 MTN002	2.1000	5.0000	5.0000	AAA	—
24 珠海港 MTN002	2.2900	5.0000	5.0000	AAA	—
24 冀中能源 MTN014B(科创票据)	3.1000	5.0000	5.0000	AAA	—
24 石交投集 MTN001A	2.2400	5.0000	5.0000	AAA	AAA
24 日照能源 MTN002	2.5500	5.0000	5.0000	AA+	—
24 融汇财富 MTN001B	2.5600	5.0000	5.0000	AA+	—
24 广西路桥 MTN005(科创票据)	2.4200	5.0000	5.0000	AA+	—
24 青岛海洋 MTN001	2.7900	5.0000	5.0000	AA+	—
24 扬州交通 MTN001	2.3000	5.0000	5.0000	AA+	—
24 金潼工业 MTN001	3.2500	5.0000	5.0000	AA	—
24 洛阳弘义 MTN001	2.5700	5.0000	5.0000	AA	—
24 建邺高科 MTN002	2.3400	5.0000	4.7000	AA+	—
24 乌高新 MTN003	2.3200	5.0000	4.4000	AA+	—

24 新津新城 MTN001	2.4500	5.0000	4.3000	AA	—
24 国药租赁 MTN005	2.3500	5.0000	4.2000	AAA	—
24 宿迁国投 MTN001	2.2500	5.0000	4.0000	AA+	—
24 无锡创新 MTN002	2.1700	5.0000	3.1000	AA+	—
24 历下控股 MTN003	2.4500	5.0000	3.0000	AA+	—
24 乐清国投 MTN004	2.3000	5.0000	2.5000	AA+	—
24 海兴 MTN004	2.4200	5.0000	2.0000	AA+	—
24 镇江产投 MTN004	2.2700	5.0000	1.2800	AAA	—
24 益阳交投 MTN002	2.3100	5.0000	1.0400	AA	—
24 滨建投 MTN009	2.9400	7.0000	6.0000	AAA	—
24 石交投集 MTN001B	2.3900	7.0000	5.0000	AAA	AAA
24 国电 MTN002	2.3000	10.0000	30.0000	AAA	—
24 鲲鹏投资 MTN004A	2.5400	10.0000	20.0000	AAA	AAA
24 苏交通 MTN011	2.4000	10.0000	20.0000	AAA	—
24 华能 MTN008	2.3600	10.0000	13.0000	AAA	AAA
24 中冶 MTN007	2.7500	10.0000	12.0000	AAA	AAA
24 郑州公用 MTN003	2.5700	10.0000	10.0000	AAA	—
24 扬子国资 MTN001	2.6500	10.0000	7.0000	AAA	—
24 中远海运 MTN001	2.3700	15.0000	30.0000	AAA	—
24 陕西交通 MTN007	2.4900	15.0000	20.0000	AAA	AAA
24 云能投 MTN018	3.0000	15.0000	15.0000	AAA	—
24 扬城建 MTN005	2.5500	15.0000	10.0000	AAA	AAA
24 鲲鹏投资 MTN004B	2.7000	20.0000	10.0000	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 1.95%；6 个月品种收益率较前周上行 3BP，上周收于 1.95%；1 年期品种收益率与前周持平，上周收于 1.93%。
- 中期票据方面，收益率小幅上行。AAA 级中期票据中，3 年期品种收益率较前周上行 3BP，上周收于 2.17%；5 年期品种收益率较前周上行 3BP，上周收于 2.29%。

- 企业债方面，收益率小幅上行。AAA 级企业债中，3 年期品种收益率较前周上行 2BP，上周收于 2.06%；5 年期品种收益率较前周上行 3BP，上周收于 2.15%；10 年期品种收益率较前周上行 3BP，上周收于 2.35%。

五、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 5.7BP，上周收于 3.883%。
- 德国国债价格下跌，10 年期德国国债收益率较前周上行 2.2BP，上周收于 2.247%。

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	4.050	-0.3	-20.8	-20.0
5 年	3.757	-3.9	-15.6	-9.0
10 年	3.883	-5.7	-14.7	0.3
30 年	4.140	-7.8	-16.3	11.2
德国国债				
2 年	2.433	4.7	-9.8	2.9
5 年	2.174	4.2	-5.8	22.6
10 年	2.247	2.2	-5.7	22.3
30 年	2.467	0.9	-4.7	20.4

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 4.78BP，上周收于 3.4447%。

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	3.8511	-1.04	-25.64	-21.46
10 年	3.4447	-4.78	-15.83	-2.93
30 年	3.3350	-5.60	-17.20	1.89

数据来源: Bloomberg

六、贵金属市场上周概览

- 黄金价格较前周上涨 3.14%，上周最高 2509.65 美元/盎司、最低 2423.68 美元/盎司，收于 2507.28 美元/盎司。
- 白银价格较前周上涨 5.71%，上周最高 29.05 美元/盎司、最低 27.16 美元/盎司，收于 29.01 美元/盎司。
- 铂金价格较前周上涨 3.50%，上周最高 961.62 美元/盎司、最低 916.87 美元/盎司，收于 954.44 美元/盎司。
- 钯金价格较前周上涨 5.05%，上周最高 952.75 美元/盎司、最低 899.50 美元/盎司，收于 950.93 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	2507.28	3.14%	2.42%
白银	29.01	5.71%	-0.11%
铂金	954.44	3.50%	-2.22%
钯金	950.93	5.05%	2.77%

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 0.28%，上周最高 78.54 美元/桶、最低 74.52 美元/桶，收于 75.49 美元/桶。

- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 0.15%，上周最高 82.40 美元/桶、最低 78.62 美元/桶，收于 79.58 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	75.49	-0.28%	-2.61%
ICE Brent 主力合约	79.58	0.15%	-2.37%

数据来源：Refinitiv

八、基本金属市场上周概览

- LME3 月期铜价格较前周上涨 3.92%，上周最高 9177.50 美元/吨、最低 8831.00 美元/吨，收于 9177.50 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周上涨 3.18%，上周最高 2368.00 美元/吨、最低 2295.00 美元/吨，收于 2368.00 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	9177.50	3.92%	-0.68%
LME 3 月铝	2368.00	3.18%	2.29%

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 4.62%，上周最高 1002.50 美分/蒲式耳、最低 955.00 美分/蒲式耳，收于 955.25 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)	528.50	-2.49%	0.24%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	955.25	-4.62%	-6.67%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	392.25	-0.76%	-1.94%
ICE 棉花(美分/磅)	67.24	-1.67%	-2.40%
ICE 白糖(美分/磅)	18.10	-2.37%	-4.84%

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 1.48%，上周最高 2.301 美元/百万英热单位、最低 2.111 美元/百万英热单位，收于 2.129 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	2.129	-1.48%	4.31%

数据来源：Refinitiv