

工银市场周报 (9月9日-9月14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9月18日

2024年第37期 总第588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 7.1030,较前周贬值约 0.15%;银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.09%,上周收于 7.0943;1年期掉期点较前周上行 89 个点,上周收于-2036。	
◆1年期境外美元对人民币无本金交割远期(NDF)较前周上行 180 个点,上周收于 6.9135。	
二、外币汇率市场上周概览	2
◆美元指数较前周下跌 0.06%,上周收于 101.114。	
◆欧元兑美元较前周下跌 0.06%,上周收于 1.1076。	
◆美元兑日元较前周下跌 1.02%,上周收于 140.82。	
◆澳元兑美元较前周上涨 0.49%,上周收于 0.6703。	
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 1.61%和 1.62%,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 1.75%和 1.80%。	
◆二级市场:10年期国债收益率较前周下行 10BP,上周收于 2.04%;5年期国债收益率较前周下行 7BP,上周收于 1.86%。	
◆一级市场:财政部招标发行 1年、5年和 7年期附息国债,以及 28天和 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年和 10年期固息债;国开行招标发行 2年、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 66支,规模合计 543.88 亿元;短期融资券 14支,规模合计 67.90 亿元;中期票据 103支,规模合计 1256.22 亿元。	
◆二级市场:短期融资券收益率区间震荡,中期票据和企业债收益率均下行	
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 3.651%。	
◆德国国债价格上涨,10年期德国国债收益率较前周下行 2.4BP,上周收于 2.148%。	
六、贵金属市场上周概览	12
◆黄金价格较前周上涨 3.18%,上周收于 2576.50 美元/盎司。	
◆白银价格较前周上涨 9.80%,上周收于 30.66 美元/盎司。	
◆铂金价格较前周上涨 8.00%,上周收于 995.26 美元/盎司。	
◆钯金价格较前周上涨 17.33%,上周收于 1068.43 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上涨 1.28%,上周收于 68.29 美元/桶。	
◆BRENT 原油期货主力合约价格较前周上涨 0.99%,上周收于 72.18 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 3.38%,上周收于 9257.00 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上涨 0.20%,上周收于 1006.50 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上涨 0.22%,上周收于 2.294 美元/百万英热单位。	

一、人民币汇率市场上周概览（2024 年 9 月 9 日-9 月 13 日）

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周五（9 月 13 日）报 7.1030，较前周贬值约 0.15%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周贬值约 0.09%，上周最高 7.0905、最低 7.1258，收于 7.0943，波幅为 0.50%。
- 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 89 个点，上周最高-2015、最低-2220，收于 -2036，波幅为 10.07%。
- 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 180 个点，上周最高 6.9467、最低 6.8810，收于 6.9135，波幅为 0.95%。

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	—	—	7.1030	105	-94	203
银行间市场汇价	7.1258	7.0905	7.0943	61	62	23
掉期点						
1 个月期限	-220	-255	-227	-1	32	-19
2 个月期限	-440	-456	-440	17	3	-17
3 个月期限	-601	-660	-619	31	24	16
6 个月期限	-1135	-1240	-1143	64	37	105
1 年期限	-2015	-2220	-2036	89	3	379

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	7.1020	7.0530	7.0615	100	-120	-101

2 个月期限	7.0775	7.0297	7.0410	130	-215	-93
3 个月期限	7.0572	7.0102	7.0225	120	-265	-99
6 个月期限	7.0072	6.9622	6.9745	130	-370	-55
1 年期限	6.9467	6.8810	6.9135	180	-350	228

数据来源：Refinitiv

二、外币汇率市场上周概览（2024 年 9 月 9 日-9 月 13 日）

- 美元指数较前周下跌 0.06%，上周最高 101.839、最低 100.883，收于 101.114。
- 欧元兑美元较前周下跌 0.06%，上周最高 1.1101、最低 1.1001，收于 1.1076。
- 美元兑日元较前周下跌 1.02%，上周最高 143.79、最低 140.27，收于 140.82。
- 澳元兑美元较前周上涨 0.49%，上周最高 0.6732、最低 0.6620，收于 0.6703。

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	101.114	-0.06%	-0.57%
欧元/美元	1.1076	-0.06%	0.26%
美元/日元	140.82	-1.02%	-3.65%
澳元/美元	0.6703	0.49%	-0.90%

数据来源：Refinitiv

三、人民币利率市场上周概览（2024 年 9 月 9 日-9 月 14 日）

◆ 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 1.61%和 1.62%，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 1.75% 和 1.80%。央行公开市场方面，上周一（9 月 9 日）进行逆回购操作 915 亿元，逆回购到期 35 亿元；上周二（9 月 10 日）进行逆回购操作 1860 亿元，逆回购到期 12 亿元；上周三（9 月 11 日）进行逆回购操作 2100 亿元，逆回购到期 7 亿元；上周四（9 月 12 日）进行逆回购操作 1608 亿元，逆回购到期 633 亿元；上周五进行逆回购操作 2362 亿元，逆回购到期 1415 亿元；上周六（9 月 14 日）进行逆回购操作 1387 亿元，无逆回购到期。本周（9 月 18 日 - 9 月 20 日）将有逆回购到期 8845 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)	1.61	-11	8
7 天 Shibor (1W)	1.75	7	10
3 月期 Shibor (3M)	1.85	0	0
隔夜回购定盘利率 (FR001)	1.62	-26	-8
7 天回购定盘利率 (FR007)	1.80	-10	-7

数据来源：外汇交易中心

◆ 二级市场

- 国债方面，收益率有所下行。1 年期国债收益率较前周下行 10BP，上周收于 1.33%；5 年期国债收益率较前周下行 8BP，上周收于 1.67%；10 年期国债收益率较前周下行 10BP，上周收于 2.04%。
- 政策性金融债方面，收益率小幅下行。1 年期国开债收益率较前周下行 4BP，上周收于 1.65%；5 年期国开债收益率

较前周下行 7BP，上周收于 1.86%；10 年期国开债收益率较前周下行 9BP，上周收于 2.14%。

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	1.33	-10	-16
3 年期	1.48	-8	-18
5 年期	1.67	-8	-19
7 年期	1.89	-9	-19
10 年期	2.04	-10	-15

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	-4	-6
3 年期	1.78	-3	-11
5 年期	1.86	-7	-15
7 年期	2.00	-10	-10
10 年期	2.14	-9	-13

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 28 天期贴现国债，以及 1 年和 5 年期付息国债；上周五财政部招标发行 91 天贴现国债，以及 7 年期付息国债。
- 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 2 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、5 年和 7 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 -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下行 0BP 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	1.87	5	5
6 月期	1.82	3	2
9 月期	1.76	2	-1
1 年期	1.72	2	-3
3 年期	1.67	0	-8
4 年期	1.69	-2	-11
5 年期	1.71	-4	-13
7 年期	1.86	-1	-8
10 年期	1.96	-1	-8
3 月 Shibor（ACT/360）			
6 月期	1.91	0	2
9 月期	1.84	0	-3
1 年期	1.79	0	-5
2 年期	1.73	-3	-10
3 年期	1.72	-4	-12
4 年期	1.75	-4	-13
5 年期	1.78	-5	-15
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（2024 年 9 月 9 日-9 月 14 日）

◆ 一级市场

- 上周共发行超短期融资券 66 支，规模合计 543.88 亿元；短期融资券 14 支，规模合计 67.90 亿元；中期票据 103 支，规模合计 1256.22 亿元。
- 上周交易商协会收益率估值各期限下行 0BP 至 2BP。

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 粤交投 SCP001	1.91	21D	15.00	AAA	—
24 中化股 SCP003	2.02	34D	40.00	AAA	—
24 华电江苏 SCP016	2.07	39D	8.00	AAA	—
24 华电江苏 SCP015	2.10	44D	9.00	AAA	—
24 航天电子 SCP009	2.18	54D	10.68	AA+	—
24 扬州经开 SCP003	2.14	60D	5.00	AA	—
24 中建八局 SCP015(科创票据)	2.00	86D	30.00	AAA	—
24 中交一公 SCP006(科创票据)	2.04	90D	20.00	AAA	—
24 广州港 SCP007	1.97	90D	14.00	AAA	—
24 广州港 SCP008	1.97	90D	9.00	AAA	—
24 四川港投 SCP002	1.95	90D	5.00	AAA	—
24 苏农垦 SCP010	2.00	90D	5.00	AAA	—
24 中交三航 SCP015(科创票据)	2.05	94D	5.00	AAA	—
24 金鼎产融 SCP004	2.25	100D	5.00	AA+	—
24 深圳环水 SCP001	2.09	126D	7.00	AAA	—

24 宁沪高 SCP015	2.02	126D	4.00	AAA	—
24 大唐发电 SCP003	1.95	128D	20.00	AAA	—
24 龙岩汇金 SCP003	2.00	135D	2.50	AA+	—
24 大唐租赁 SCP006	2.07	163D	7.00	AAA	—
24 龙岩汇金 SCP004	2.05	175D	2.50	AA+	—
24 天成租赁 SCP008	2.08	177D	10.00	AAA	—
24 鲁高速股 SCP004	2.04	177D	10.00	AAA	—
24 龙源电力 SCP016	2.04	180D	20.00	AAA	—
24 中盐 SCP001	2.09	180D	7.00	AAA	—
24 龙盛 SCP014(科创票据)	2.16	180D	5.50	AAA	—
24 徐州新盛 SCP001	1.98	180D	4.30	AAA	—
24 苏州交投 SCP004	1.91	180D	3.00	AAA	—
24 滨湖建设 SCP016	2.14	180D	3.00	AA+	—
24 华电租赁 SCP008	2.10	184D	5.00	AAA	—
24 国网租赁 SCP018	2.05	194D	10.00	AAA	—
24 厦港务 SCP002	2.08	210D	10.00	AAA	—
24 华电产融 SCP009	2.10	210D	5.00	AAA	—
24 华电产融 SCP010	2.10	210D	3.00	AAA	—
24 深圳租赁 SCP003	2.19	221D	5.00	AA+	—
24 金隅 SCP002	2.10	245D	10.00	AAA	—
24 平安点创 SCP005	2.31	247D	4.00	AA+	—
24 越秀租赁 SCP006	2.12	252D	6.00	AAA	—
24 杭州热联 SCP008	2.20	267D	10.00	AA+	—
24 上海医药 SCP003	2.04	268D	30.00	AAA	—
24 华数传媒 SCP003	2.09	268D	5.00	AAA	—
24 华友钴业 SCP006(科创票据)	3.00	268D	7.00	AA+	—
24 昆明交通 SCP005	2.83	270D	18.50	AAA	—
24 陕西建工 SCP009	2.40	270D	10.00	AAA	—
24 平安租赁 SCP013	2.17	270D	10.00	AAA	—
24 济南高新 SCP006	2.13	270D	10.00	AAA	—
24 中铁十一 SCP001(科创票据)	2.09	270D	10.00	AAA	—
24 安瑞科控 SCP001	2.02	270D	5.00	AAA	—
24 甘国投 SCP007	2.14	270D	5.00	AAA	—
24 复星高科 SCP006	4.50	270D	5.00	AAA	—
24 冀建投 SCP003	2.08	270D	5.00	AAA	—
24 甘国投 SCP006	2.14	270D	5.00	AAA	—
24 锡交通 SCP007	1.93	270D	3.00	AAA	—
24 锡交通 SCP006	1.94	270D	3.00	AAA	—
24 津南城投 CP004	2.27	270D	10.00	AA+	—
24 株国投 SCP002	2.15	270D	5.00	AA+	—
24 冀中峰峰 SCP001	2.80	270D	5.00	AA+	—
24 鲁商 SCP008	2.70	270D	5.00	AA+	—

24 凤城河 SCP003	2.15	270D	5.00	AA+	—
24 江津园区 SCP001	2.16	270D	5.00	AA+	—
24 长寿投资 SCP003	2.22	270D	5.00	AA+	—
24 衢通发展 SCP005	2.05	270D	4.00	AA+	—
24 宿迁交通 SCP003	2.09	270D	4.00	AA+	—
24 渝惠通 SCP002	2.19	270D	3.50	AA+	—
24 宿迁水务 SCP004	2.12	270D	2.00	AA+	—
24 黄石城投 SCP003	2.21	270D	2.40	AA	—
24 江宁水 SCP002	2.14	270D	2.00	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	债券评级
24 花园 CP002	4.60	364D	5.00	AA+	—
24 兴滁矿业 CP001	3.20	364D	1.60	AA	—
24 淄博城资 CP004	2.17	365D	12.00	AAA	—
24 迈瑞城投 CP001	2.22	365D	9.50	AA+	—
24 武清国资 CP001	2.26	365D	8.00	AA+	—
24 建安投资 CP002	2.15	365D	5.00	AA+	—
24 海安开投 CP006	2.15	365D	5.00	AA+	—
24 海沧投资 CP003	2.15	365D	5.00	AA+	—
24 盛虹科技 CP004	2.90	365D	3.00	AA+	—
24 成都经开 CP001	2.17	365D	2.30	AA+	—
24 乐清国投 CP001	2.10	365D	2.00	AA+	—
24 高淳建设 CP011	2.19	365D	5.00	AA	—
24 大足永晟 CP004	2.53	365D	2.50	AA	A-1
24 苏通 CP001	2.16	365D	2.00	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 南航租赁 MTN001	2.15	1.50	10.00	AA+	—
24 远东租赁 MTN006	3.01	2.00	5.00	AAA	—
24 湘高速 MTN013	2.05	2.00	20.00	AAA	—
24 华电股 MTN007	2.09	2.00	16.00	AAA	—
24 悦达 MTN004	2.73	2.00	3.00	AAA	—
24 大唐集 MTN008	2.16	3.00	30.00	AAA	AAA
24 豫交投 MTN008	2.21	3.00	25.00	AAA	AAA
24 华侨城 MTN003	3.53	3.00	20.00	AAA	AAA
24 云投 MTN014	2.78	3.00	20.00	AAA	—
24 中建五局 MTN002(科创票 据)	2.30	3.00	18.00	AAA	AAA
24 中建七局 MTN001(科创票 据)	2.36	3.00	15.00	AAA	AAA
24 大众汽车 MTN001BC	2.29	3.00	15.00	AAA	—
24 中建四局 MTN001(科创票 据)	2.42	3.00	15.00	AAA	AAA

24 华能水电 GN004(乡村振兴)	2.20	3.00	15.00	AAA	-
24 南京地铁 GN006(碳中和债)	2.12	3.00	10.00	AAA	-
24 津城建 MTN033	2.48	3.00	10.00	AAA	-
24 淮河能源 MTN002	2.40	3.00	10.00	AAA	-
24 桂投资 MTN008	2.63	3.00	10.00	AAA	-
24 京汽集 MTN005	2.25	3.00	10.00	AAA	-
24 光大绿环 MTN003	2.43	3.00	10.00	AAA	AAA
24 吉利 MTN004(科创票据)	2.29	3.00	10.00	AAA	-
24 京能国际 MTN003(BC)	2.49	3.00	10.00	AAA	AAA
24 河钢集 MTN015	2.45	3.00	10.00	AAA	-
24 桂交投 MTN017A	2.30	3.00	10.00	AAA	-
24 水发集团 MTN009	2.86	3.00	9.00	AAA	AAA
24 闽高速 MTN001	2.12	3.00	5.00	AAA	-
24 泰达投资 MTN004A	2.90	3.00	1.00	AAA	AAA
24 漂水城建 MTN005	2.25	3.00	12.77	AA+	-
24 徐州矿务 MTN001	2.11	3.00	10.00	AA+	-
24 晋城国资 MTN002	2.35	3.00	10.00	AA+	-
24 华电云南 MTN001(两新)	2.26	3.00	6.00	AA+	-
24 太仓城投 MTN002	2.16	3.00	5.40	AA+	-
24 吴中城投 MTN004	2.23	3.00	5.00	AA+	-
24 光明房产 MTN006	2.86	3.00	5.00	AA+	-
24 国贸资本 MTN002	2.39	3.00	5.00	AA+	AAA
24 昌阳投资 MTN002	2.57	3.00	5.00	AA+	-
24 水利四 MTN001(科创票据)	2.40	3.00	5.00	AA+	AA+
24 滨湖建设 MTN004	2.27	3.00	5.00	AA+	-
24 高淳国资 MTN003	2.32	3.00	4.80	AA+	-
24 宿迁交通 MTN004	2.25	3.00	4.50	AA+	-
24 牛首山 MTN001	2.60	3.00	4.00	AA+	AA+
24 瀚瑞投资 MTN005	2.35	3.00	4.00	AA+	-
24 鲁宏桥 GN002	2.95	3.00	3.00	AA+	AA+
24 中陕核工 MTN002	2.60	3.00	3.00	AA+	AA+
24 北辰建设 MTN002	2.90	3.00	2.50	AA+	-
24 扬州经开 MTN003	2.55	3.00	8.00	AA	-
24 吴中交投 MTN002	2.28	3.00	7.70	AA	-
24 临桂城投 MTN002	3.89	3.00	5.70	AA	AA
24 高教投资 MTN002	2.37	3.00	5.00	AA	-
24 顺鑫 MTN002	2.39	3.00	5.00	AA	-
24 云能投 MTN021	2.95	4.00	10.00	AAA	-
24 中油股 MTN002	2.08	5.00	100.00	AAA	-
24 铁道 MTN007A	2.04	5.00	100.00	AAA	AAA
24 浙交投 MTN001	2.18	5.00	20.00	AAA	-
24 苏交通 MTN012	2.20	5.00	20.00	AAA	-
24 中电投 MTN022	2.10	5.00	19.00	AAA	-
24 徐工机械 MTN002(科创票)	2.18	5.00	15.00	AAA	-

据)					
24 兴城投资 MTN003B	2.32	5.00	15.00	AAA	AAA
24 安瑞科控 MTN002	2.37	5.00	15.00	AAA	AAA
24 豫航空港 MTN018	3.07	5.00	15.00	AAA	—
24 首开 MTN006	3.30	5.00	13.00	AAA	—
24 鄂联投 MTN008	2.72	5.00	10.00	AAA	—
24 天津轨交 MTN009	2.70	5.00	10.00	AAA	—
24 川能投 MTN006	2.28	5.00	10.00	AAA	—
24 陕有色 MTN004	2.29	5.00	10.00	AAA	AAA
24 陕西交通 MTN008	2.35	5.00	10.00	AAA	AAA
24 中建一局 MTN001 (科创票					
据)	2.42	5.00	10.00	AAA	—
24 招商资本 MTN001 (科创票					
据)	2.36	5.00	10.00	AAA	AAA
24 云能投 MTN020	2.77	5.00	10.00	AAA	—
24 中船租 MTN001	2.36	5.00	8.00	AAA	—
24 温公用 MTN003	2.30	5.00	5.00	AAA	—
24 京城投 MTN006	2.40	5.00	5.00	AAA	—
24 桂交投 MTN017B	2.45	5.00	5.00	AAA	—
24 重庆轨交 GN004 (碳中和债)	2.27	5.00	5.00	AAA	—
24 泰达投资 MTN004B	3.50	5.00	1.55	AAA	AAA
24 嘉兴产业 MTN002	2.38	5.00	15.00	AA+	—
24 长兴金控 MTN001	2.58	5.00	10.00	AA+	—
24 常德城投 MTN002	2.47	5.00	10.00	AA+	—
24 长兴交投 MTN001	2.60	5.00	9.41	AA+	—
24 菏泽投资 MTN001	2.50	5.00	8.00	AA+	—
24 江北公用 MTN002	2.41	5.00	8.00	AA+	—
24 苏新国资 MTN010	2.35	5.00	8.00	AA+	—
24 连云港 MTN003	3.50	5.00	7.00	AA+	—
24 寿光城控 MTN003	4.00	5.00	5.88	AA+	—
24 九合财金 MTN003	3.90	5.00	5.60	AA+	AA+
24 赣州建投 MTN001	3.00	5.00	5.32	AA+	—
24 中核二四 MTN001	2.50	5.00	5.00	AA+	—
24 张家经开 MTN003	2.37	5.00	4.50	AA+	—
24 菏泽城投 MTN001	2.60	5.00	4.09	AA+	—
24 东龙控股 MTN002	2.88	5.00	3.50	AA+	—
24 郑州经开 MTN001	2.58	5.00	2.00	AA+	—
24 宜春创业 MTN001	2.74	5.00	9.00	AA	AA
24 西汇投资 MTN001A	2.60	5.00	5.00	AA	—
24 金合盛 MTN005	2.35	5.00	4.00	AA	—
24 中油股 MTN001 (绿色两新)	2.24	10.00	30.00	AAA	—
24 国开投 MTN001	2.34	10.00	25.00	AAA	AAA
24 赣投 MTN002	2.65	10.00	10.00	AAA	—
24 川投资 MTN004	2.57	10.00	10.00	AAA	AAA

24 兴城投资 MTN003C	2.60	10.00	6.00	AAA	AAA
24 粤电发 MTN003	2.52	15.00	6.00	AAA	AAA
24 铁道 MTN007B	2.30	20.00	100.00	AAA	AAA
24 皖交控 MTN005(两新)	2.51	30.00	10.00	AAA	—
24 国开投 MTN002	2.49	30.00	5.00	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 5BP，上周收于 2.02%；6 个月品种收益率与前周持平，上周收于 2.00%；1 年期品种收益率较前周下行 5BP，上周收于 2.01%。
- 中期票据方面，收益率小幅下行。AAA 级中期票据中，3 年期品种收益率较前周下行 3BP，上周收于 2.12%；5 年期品种收益率较前周下行 2BP，上周收于 2.25%。
- 企业债方面，收益率有所下行。AAA 级企业债中，3 年期品种收益率较前周下行 1BP，上周收于 2.08%；5 年期品种收益率较前周下行 4BP，上周收于 2.15%；10 年期品种收益率较前周下行 8BP，上周收于 2.32%。

五、外币利率市场上周概览（2024 年 9 月 9 日-9 月 13 日）

◆ 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 3.651%。

- 德国国债价格上涨，10 年期德国国债收益率较前周下行 2.4BP，上周收于 2.148%。

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	3.582	-6.4	-33.4	-66.8
5 年	3.431	-5.4	-27.2	-41.6
10 年	3.651	-5.7	-25.2	-22.8
30 年	3.980	-3.9	-21.6	-4.9
德国国债				
2 年	2.211	-1.9	-18.0	-19.3
5 年	2.020	-2.6	-16.9	7.2
10 年	2.148	-2.4	-15.1	12.4
30 年	2.431	-0.5	-11.5	16.8

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 5.50BP，上周收于 3.1900%。

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	3.3840	-5.45	-33.15	-68.17
10 年	3.1900	-5.50	-24.67	-28.40
30 年	3.1649	-3.66	-21.10	-15.12

数据来源：Bloomberg

六、贵金属市场上周概览（2024 年 9 月 9 日-9 月 13 日）

- 黄金价格较前周上涨 3.18%，上周最高 2585.99 美元/盎司、最低 2485.40 美元/盎司，收于 2576.50 美元/盎司。
- 白银价格较前周上涨 9.80%，上周最高 30.92 美元/盎司、最低 27.68 美元/盎司，收于 30.66 美元/盎司。

- 铂金价格较前周上涨 8.00%，上周最高 1005.82 美元/盎司、最低 917.28 美元/盎司，收于 995.26 美元/盎司。
- 钯金价格较前周上涨 17.33%，上周最高 1076.50 美元/盎司、最低 909.50 美元/盎司，收于 1068.43 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	2576.50	3.18%	2.93%
白银	30.66	9.80%	6.28%
铂金	995.26	8.00%	7.48%
钯金	1068.43	17.33%	10.69%

数据来源：Refinitiv

七、原油市场上周概览（2024 年 9 月 9 日-9 月 13 日）

- WTI 原油期货主力合约价格较前周上涨 1.28%，上周最高 70.32 美元/桶、最低 65.27 美元/桶，收于 68.29 美元/桶。
- Brent 原油期货主力合约价格较前周上涨 0.99%，上周最高 73.24 美元/桶、最低 68.68 美元/桶，收于 72.18 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	68.29	1.28%	-6.12%
ICE Brent 主力合约	72.18	0.99%	-6.32%

数据来源：Refinitiv

八、基本金属市场上周概览（2024 年 9 月 9 日-9 月 13 日）

- LME3 月期铜价格较前周上涨 3.38%，上周最高 9257.00 美元/吨、最低 8954.00 美元/吨，收于 9257.00 美元/吨。
- LME3 月期铝价格较前周上涨 5.62%，上周最高 2473.00 美元/吨、最低 2341.50 美元/吨，收于 2473.00 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	9257.00	3.38%	0.06%
LME 3 月铝	2473.00	5.62%	1.10%

数据来源：Bloomberg

九、农产品市场上周概览（2024 年 9 月 9 日-9 月 13 日）

- CBOT 大豆期货主力合约价格较前周上涨 0.20%，上周最高 1021.00 美分/蒲式耳、最低 995.50 美分/蒲式耳，收于 1006.50 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)	595.25	4.98%	7.84%
CBOT 大豆(美分/蒲式耳)	1006.50	0.20%	0.75%
CBOT 玉米(美分/蒲式耳)	413.75	1.85%	3.05%
ICE 棉花(美分/磅)	69.86	2.99%	-0.13%
ICE 白糖(美分/磅)	19.32	0.42%	-1.93%

数据来源：Refinitiv

十、天然气市场上周概览（2024 年 9 月 9 日-9 月 13 日）

- NYMEX 天然气期货主力合约价格较前周上涨 0.22%，上周最高 2.407 美元/百万英热单位、最低 2.125 美元/百万英

热单位，收于 2.294 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	2.294	0.22%	6.90%

数据来源：Refinitiv