



【2024-10-28】

国债

央行公告称，为维护月末银行体系流动性合理充裕，10月28日以固定利率、数量招标方式开展了2416亿元7天期逆回购操作，操作利率1.50%。Wind数据显示，今日2089亿元逆回购到期。

国债方面 270D 240015 1.3875-1.39； 2.8Y 240016 1.61-1.625； 4.71Y 240014 1.8275-1.845； 6.66Y 240013 2.03-2.06； 9.57Y 240011 2.135-2.15； 28.96Y 230023 2.33-2.355。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.3900	1.6150	1.8300	2.0300	2.1375	2.3330
今日国债(%)	1.3875	1.6175	1.8300	2.0425	2.1425	2.3575
变动(%)	-0.0025	0.0025	0.0000	0.0125	0.0050	0.0245

金融债

金融债方面 270D 240421 1.72-1.73； 4.32Y 240203 1.87-1.90； 5.98Y 200215 2.08-2.10； 9.68Y 240420 2.2675-2.2725。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.7300	1.8500	1.9300	2.1700	2.2600
今日非国开金融债(%)	1.7300	1.8500	1.9400	2.1175	2.2725
变动(%)	0.0000	0.0000	0.0100	-0.0525	0.0125
昨日国开债(%)	1.7300	1.8300	1.8880	2.1150	2.2180
今日国开债(%)	1.7300	1.8300	1.8950	2.1425	2.2275
变动(%)	0.0000	0.0000	0.0070	0.0275	0.0095

短期融资券

今日银行间短融市场交投活跃，成交主要集中于明年Q3期限。短端方面，18D 012482433.IB 24沪电力 SCP016 AAA 在1.94%成交（估值-3位置），基金出给资管；29D 012481236.IB 24首创生态 SCP002 AAA 在1.94%成交（估值位置），基金出给基金。中长端方面，109D 012481597.IB 24鲁高速 SCP002 AAA 在2.05%成交（估值-2位置），基金出给基金；123D 012481740.IB 24浦发集团 SCP003 AAA 在2.04%成交（估值-1位置），银行出给基金。长端方面，204D 012482552.IB 24赣粤 SCP003 AAA 在2.09%成交（估值位置），银行出给基金；239D 042480321.IB 24电网 CP004 AAA 在2.00%成交，估值-1位置，银行出给银行。总体而言，短端、中长端和长端收益变动不大。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	1.93		2.03		2.07		2.07		2.09	
	AA+	1.94		2.11		2.12		2.12		2.15	
	AA	2.03		2.12		2.18		2.2		2.23	
	AA-	2.23		2.31		2.31		2.33		2.34	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	1.94	-1	2	3	2.13	-6	2.09	-2	2.05	4
	AA+	2	-6	2.06	5	2.1	2	2.09	3	2.09	6
	AA	2.04	-1	2.21	-9	2.18	0	2.15	5	2.16	7
	AA-	2.1	13	2.2	11	2.2	11	2.3	3	2.27	7

中期票据

今日中票交投情绪活跃，1-3 年短端中票，23 光大环境 MTN003（AAA，2.07Y）在 2.38%高估值 4bp 的位置成交；22 中建七局 MTN001（AAA，1.00Y）在 2.19%低估值 2bp 位置成交；16 武汉地铁 GN002（AAA，1.99Y）在 2.20%低估值 1bp 位置成交；3 到 5 年期限，24 南电 MTN005（AAA，4.41Y）在 2.33%高估值 1bp 位置成交；24 汇金 MTN003（AAA，4.56Y）成交在 2.34%高估值 2bp 位置成交；24 江西交投 MTN007（AAA，4.61Y）成交在 2.53%，高估值 6bp 位置。5Y 及以上期限，24 京国资 MTN001A（AAA，9.28Y）在 2.59%高估值 4bp 成交；24 青岛地铁 MTN001B（AAA，9.7Y）成交在 2.98%，高估值 3bp 的位置成交。总体而言，今日中票收益震荡，略有上行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.06		2.26		2.38		2.51		None	
	AAA	2.19		2.37		2.54		None		None	
	AA+	2.35		2.49		2.73		None		None	
	AA	2.45		2.63		3.01		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.08	-2	2.23	3	2.35	3	2.5	1	None	None
	AAA	2.21	-2	2.34	3	2.52	2	None	None	None	None
	AA+	2.35	0	2.47	2	2.71	2	None	None	None	None
	AA	2.46	-1	2.61	2	2.99	2	None	None	None	None

企业债

今日企业债交投较为活跃，基金，券商，银行，保险和券商资管均有参与。可质押方面， 19 海控 02 AAA 成交在 2.18%，基金卖出，基金买入。20 浦集 01 AAA 成交在 2.09%，基金卖出，理财买入。22 五资 01 AAA 成交在 2.10%。城投方面，20 沪建 01 AAA 成交在 2.10%，理财卖出，理财买入。19 冶投 02 AA 成交在 2.90%，券商卖出，基金买入。23 明宫 01 AA 成交在 4.40%。长端方面，24 葛洲 K2 AAA 成交在 2.62%，券商资管卖出，保险买入。24 济建 G2 AAA 成交在 2.95%，券商资管卖出，基金买入。24 深业 03 AAA 成交在 2.54%。

银行债

今日银行债成交活跃度较上周五有所下降，盘中小幅震荡，整体收益率上行，各期限均换手充分。早盘买卖力量均衡，5 年的大行永续 24 中行永续债 01 成交在估值附近，随后震荡上行至估值+1.32，临近尾盘上行至估值+1.82，基金、理财和券商出给基金、银行、理财和券商。3Y 附近，22 农行二级资本债 02A 早盘成交在估值-1，随后上行至估值+1 直至收盘，理财、基金之间易手。短端方面，成交较为清淡。一年内次级成交在估值-0.5 至+0.5 之间。基金出给保险。商金方面，成交多在估值+0.5 附近，24 中信银行债 01 成交在 2.17（+0.44），基金、券商资管出给基金。

美元债

美债利率继续上行。投资级方面，需求仍主要集中在短久期资产，但部分关注绝对收益的投资人瞄准中长期资产买入。城投板块，1 年以内短券需求较好，明年 4 月到期杭州上城成交在 5.3%位置。地产板块，新城曲线继续上涨 0.5-1pt，路劲下跌 0.25-0.5pt。

今日短融成交

剩余天数	债券代码	债券代码（发行机构）	评级	收益率
3D	042380626.IB	23 长寿投资 CP001	AA+	2.31%
18D	012482433.IB	24 沪电力 SCP016	AAA	1.94%
18D	012482433.IB	24 沪电力 SCP016	AAA	1.94%
22D	012482214.IB	24 大唐新能 SCP002	AAA	1.97%
29D	012481697.IB	24 南航集 SCP003	AAA	1.92%
29D	012481236.IB	24 首创生态 SCP002	AAA	1.94%
29D	012481236.IB	24 首创生态 SCP002	AAA	1.94%
42D	012480850.IB	24 南投集团 SCP001	AA+	2.25%
48D(休 1)	042380742.IB	23 昆明城建 CP003	AA+	2.97%
54D(休 2)	042380750.IB	23 萧山国资 CP003	AAA	2.07%
55D(休 1)	012481931.IB	24 瘦西湖 SCP005	AA+	2.20%
58D	012483160.IB	24 江苏广电 SCP012(科创票据)	AAA	1.99%
81D	012481372.IB	24 皖投集 SCP001	AAA	2.08%
106D	012481591.IB	24 古井 SCP001	AA+	2.11%
106D	012481591.IB	24 古井 SCP001	AA+	2.11%
109D	012481597.IB	24 鲁高速 SCP002	AAA	2.05%
112D	012481623.IB	24 先行控股 SCP002	AA+	2.33%
113D	012400349.IB	24 渝惠通 SCP001	AA+	2.34%
113D	012400349.IB	24 渝惠通 SCP001	AA+	2.34%
113D	012481652.IB	24 青岛海控 SCP003	AAA	2.30%
113D	012481652.IB	24 青岛海控 SCP003	AAA	2.30%
123D	012481780.IB	24 环球租赁 SCP008	AAA	2.20%
123D	012481740.IB	24 浦发集团 SCP003	AAA	2.04%
129D	042480123.IB	24 秦皇城投 CP001	AA	2.45%
137D	042480143.IB	24 青岛上合 CP002	AAA	2.36%
162D	012482121.IB	24 中铝集 SCP003(科创票据)	AAA	2.07%
162D	012482121.IB	24 中铝集 SCP003(科创票据)	AAA	2.07%
172D	012483390.IB	24 北新 SCP001(科创票据)	AAA	2.15%

172D	012483390.IB	24 北新 SCP001(科创票据)	AAA	2.15%
183D	012482337.IB	24 天津轨交 SCP012	AAA	2.20%
201D(休 2)	042400070.IB	24 鲁宏桥 CP003	AA+	2.90%
204D	012482552.IB	24 赣粤 SCP003	AAA	2.09%
204D	042480379.IB	24 电网 CP012	AAA	2.00%
204D	042480379.IB	24 电网 CP012	AAA	2.00%
204D	042480379.IB	24 电网 CP012	AAA	2.00%
209D(休 1)	012482580.IB	24 西安高新 SCP002	AAA	2.50%
209D(休 1)	012482580.IB	24 西安高新 SCP002	AAA	2.50%
209D(休 1)	012482580.IB	24 西安高新 SCP002	AAA	2.50%
232D	012483089.IB	24 西安高新 SCP003	AAA	2.50%
239D	042480321.IB	24 电网 CP004	AAA	2.00%
267D	012483416.IB	24 中航租赁 SCP007	AAA	2.16%
271D(休 2)	042480383.IB	24 凤城河 CP004	AA+	2.40%
330D	042480477.IB	24 滨江房产 CP006	AAA	3.97%
362D(休 2)	042480534.IB	24 中国旅游 CP001	AAA	2.15%

今日中票成交

剩余天数	债券代码	债券代码（发行机构）	评级	收益率
13D(休 1)	102102271.IB	21 沪硅产业 MTN001	AA+	2.48%
13D(休 1)	102102271.IB	21 沪硅产业 MTN001	AA+	2.48%
36D	102103171.IB	21 滁州同创 MTN003	AA+	2.28%
36D+2Y	102103166.IB	21 诚通控股 MTN007	AAA	1.99%
49D	102103273.IB	21 万盛经开 MTN001	AA	2.80%
72D	102000001.IB	20 浦东开发 MTN001	AAA	2.08%
77D	102382693.IB	23 一汽租赁 MTN002	AAA	2.14%
77D	102280069.IB	22 徐州新盛 MTN002	AAA	2.15%
78D	102280101.IB	22 河钢集 MTN001	AAA	2.26%
81D	102000074.IB	20 吉安城建 MTN001	AA+/AA	2.35%
82D(休 2)	102280116.IB	22 新郑投资 MTN001	AA+	2.35%
82D(休 2)	102280115.IB	22 常州投资 MTN001	AAA	2.25%
88D	102280194.IB	22 衡阳交通 MTN001	AA/AA+	2.40%
88D	102280194.IB	22 衡阳交通 MTN001	AA/AA+	2.35%
112D	102280272.IB	22 联和投资 MTN001	AAA	2.12%
118D+3Y	102280342.IB	22 洋河 MTN001A	AAA	2.12%
118D+3Y	102280342.IB	22 洋河 MTN001A	AAA	2.11%
118D+3Y	102280342.IB	22 洋河 MTN001A	AAA	2.11%
126D	102000212.IB	20 渝富 MTN001	AAA	2.12%
131D+1Y(休 1)	102380420.IB	23 驻马店投 MTN001	AA+	2.45%
133D	102000291.IB	20 港兴港投 MTN002	AAA	2.39%
136D	102382722.IB	23 一汽租赁 MTN003	AAA	2.13%
139D(休 1)	102280530.IB	22 盐城交通 MTN001	AA+	2.38%
140D	102380568.IB	23 云能投 MTN001	AAA	2.40%
143D+NY	102380596.IB	23 华电股 MTN003(能源保供特别债)	AAA	2.16%
143D+NY	102380596.IB	23 华电股 MTN003(能源保供特别债)	AAA	2.16%
143D+NY	102380596.IB	23 华电股 MTN003(能源保供特别债)	AAA	2.16%
143D+NY	102380596.IB	23 华电股 MTN003(能源保供特别债)	AAA	2.16%
151D	102280644.IB	22 余姚高铁 MTN001	AA/AA+	2.25%
152D(休 2)	102280665.IB	22 常德经建 MTN001	AA+	2.40%
173D(休 2)	102380955.IB	23 赣州建投 MTN001	AA+	2.40%
173D(休 2)	102380955.IB	23 赣州建投 MTN001	AA+	2.39%
173D(休 2)	102380955.IB	23 赣州建投 MTN001	AA+	2.39%
175D+NY	102380994.IB	23 华电股 MTN004	AAA	2.15%
175D	102000750.IB	20 南浦口 MTN001	AA+	2.26%
175D	102000750.IB	20 南浦口 MTN001	AA+	2.26%
175D	102000750.IB	20 南浦口 MTN001	AA+	2.26%
182D	102280984.IB	22 港荣投资 MTN001	AA	2.50%
217D(休 1)	102281181.IB	22 胶州湾 MTN001	AA+	2.48%
232D	102200167.IB	22 上饶城投 MTN002	AA+	2.48%
234D+1Y(休 3)	102381463.IB	23 金坛国发 MTN001	AA+	2.41%
239D	132280058.IB	22 京汽股 GN001(科创票据)	AAA	2.15%
258D(休 1)	102281531.IB	22 中金集 MTN001	AAA	2.06%
262D	102381696.IB	23 大榭开发 MTN001	AA	2.41%
286D(休 1)	102281741.IB	22 华电江苏 MTN001	AAA	2.14%
287D	102281755.IB	22 渝高速 MTN003(乡村振兴)	AAA	2.125%
301D+2Y	102281914.IB	22 鲁西化工 MTN001	AAA	2.30%
304D	102001658.IB	20 常城建 MTN002	AAA	2.14%
305D	102281962.IB	22 白马湖 MTN001	AA/AA+	2.60%

327D(休 2)	102282107.IB	22 朝阳国资 MTN001	AAA	2.20%
330D	102282150.IB	22 国航 MTN001	AAA	2.04%
353D+1Y	102382698.IB	23 洛阳城投 MTN001	AA+	2.36%
1Y	102282394.IB	22 中建七局 MTN001	AAA	2.19%
1Y	102282394.IB	22 中建七局 MTN001	AAA	2.19%
1Y	102282394.IB	22 中建七局 MTN001	AAA	2.19%
1Y	102282394.IB	22 中建七局 MTN001	AAA	2.19%
1.02Y	102282471.IB	22 五矿集 MTN001	AAA	2.11%
1.02Y	102282471.IB	22 五矿集 MTN001	AAA	2.11%
1.02Y	102282471.IB	22 五矿集 MTN001	AAA	2.11%
1.07Y(休 2)	102383110.IB	23 广西旅发 MTN003	AA+	2.66%
1.07Y(休 2)	102383110.IB	23 广西旅发 MTN003	AA+	2.66%
1.08Y	102383173.IB	23 中航租赁 MTN003	AAA	2.19%
1.09Y	102282622.IB	22 豫水利 MTN002	AAA	2.21%
1.14Y+2Y(休 1)	102282736.IB	22 宜昌高新 MTN001	AA+	2.44%
1.25Y	102480328.IB	24 津城建 MTN007	AAA	2.63%
1.25Y	102480328.IB	24 津城建 MTN007	AAA	2.63%
1.34Y	102100316.IB	21 南州水务 MTN001	AA	2.98%
1.53Y	132100052.IB	21 重庆轨交 GN003(碳中和 债)	AAA	2.23%
1.6Y	102381283.IB	23 岳阳城运 MTN001	AA+	2.48%
1.63Y	102381419.IB	23 上饶投资 MTN001	AAA	2.56%
1.63Y	102381419.IB	23 上饶投资 MTN001	AAA	2.56%
1.72Y(休 2)	102381705.IB	23 国联 MTN005	AAA	2.30%
1.84Y(休 2)	102382295.IB	23 金桥开发 MTN001	AAA	2.37%
1.84Y(休 2)	102382295.IB	23 金桥开发 MTN001	AAA	2.37%
1.99Y(休 2)	102382828.IB	23 晋能煤业 MTN008	AAA	2.55%
1.99Y+5Y(休 1)	131656048.IB	16 武汉地铁 GN002	AAA	2.20%
2.07Y	102383151.IB	23 光大环境 MTN003	AAA	2.38%
2.09Y(休 1)	132380082.IB	23 核风电 GN003	AAA	2.25%
2.23Y	102480235.IB	24 南昌轨交 MTN001(绿色)	AAA	2.30%
2.36Y(休 1)	102480710.IB	24 鲁路桥 MTN001(科创票据)	AAA	2.60%
2.37Y(休 2)	102480850.IB	24 吉利 MTN001(科创票据)	AAA	2.53%
2.61Y	132480047.IB	24 国能新能 GN001	AAA	2.28%
2.78Y+2Y	102483446.IB	24 蔚然投资 MTN001(科创票 据)	AA+	2.49%
2.78Y+NY(休 1)	132480070.IB	24 乌江水电 GN001	AAA	2.52%
2.78Y+NY(休 1)	132480070.IB	24 乌江水电 GN001	AAA	2.52%
4.41Y	102481155.IB	24 南电 MTN005	AAA	2.33%
4.41Y	102481166.IB	24 榆林能源 MTN001	AAA	2.78%
4.41Y	102481195.IB	24 泰州城建 MTN002	AA+	2.64%
4.41Y	102481195.IB	24 泰州城建 MTN002	AA+	2.64%
4.56Y(休 1)	102481965.IB	24 潞安 MTN003	AAA	2.78%
4.56Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.34%
4.56Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.34%
4.6Y	102482136.IB	24 南山开发 MTN001B	AAA	2.75%
4.61Y+NY	102482175.IB	24 江西交投 MTN007	AAA	2.53%
4.7Y	102482941.IB	24 鲁黄金 MTN005(科创票据)	AAA	2.53%
4.72Y	102483112.IB	24 义乌国资 MTN003	AAA	2.65%
4.72Y	102483112.IB	24 义乌国资 MTN003	AAA	2.64%
4.72Y	102483112.IB	24 义乌国资 MTN003	AAA	2.62%
4.75Y(休 1)	102483250.IB	24 扬城建 MTN004	AAA	2.55%
9.78Y	102483397.IB	24 福州城投 MTN002	AAA	2.87%

今日企业债成交

剩余天数	债券代码	债券代码（发行机构）	评级	收益率
24D	138597.SH	22 华泰 G6	AAA	1.92%
24D	138597.SH	22 华泰 G6	AAA	1.92%
28D	112998.SZ	19 海控 02	AAA	2.18%
39D	162684.SH	19 新安 01	AA/AAA	2.75%
49D	114353.SH	22 商古 05	AA/AA+	2.60%
59D	148148.SZ	22 长城 04	AAA	1.91%
60D	162848.SH	19 冶投 02	AA	2.90%
125D(休 1)	166045.SH	20 振东 01	AA	3.15%
132D(休 1)	163226.SH	20 浦集 01	AAA	2.09%
137D	185529.SH	22 五资 01	AAA	2.10%
137D	185529.SH	22 五资 01	AAA	2.10%
137D	185529.SH	22 五资 01	AAA	2.10%
139D(休 1)	185550.SH	22 国君 G1	AAA	2.00%
150D+2Y(休 2)	152427.SH	20 沪建 01	AAA	2.10%
175D	163442.SH	20 延长 01	AAA	2.06%
175D	137143.SH	22SN01EB	AAA	106

182D+5Y(休 1)	139444.SH	20 尧矿 01	AAA	2.13%
200D	185768.SH	22 华安 G1	AAA	2.02%
213D+1Y	115432.SH	23 中交 K1	AAA	2.05%
245D	185939.SH	22 华电 01	AAA	2.04%
251D(休 1)	185973.SH	22 国君 G7	AAA	2.00%
252D	115584.SH	23 中证 13	AAA	2.00%
257D(休 2)	149978.SZ	22 国元 03	AAA	2.03%
266D	137547.SH	22 东证 01	AAA	2.04%
270D+1Y(休 2)	133584.SZ	23 桂债 01	AAA	2.50%
276D+3Y	114724.SH	23 枣发 01	AA+	2.85%
278D+NY(休 2)	137559.SH	22 环保 Y1	AAA	2.23%
279D(休 1)	251212.SH	23 明官 01	AA	4.40%
280D+2Y	148008.SZ	22 重发 02	AAA	2.15%
284D+NY	137601.SH	22 建发 Y4	AAA	2.45%
285D+2Y	148015.SZ	22 广电 01	AAA	2.13%
288D+2Y	148021.SZ	22 湘路 06	AAA	2.13%
290D	175014.SH	20 金隅 04	AAA	2.14%
299D(休 2)	252060.SH	23 蓝创 04	AA	3.95%
327D(休 2)	137843.SH	22 首钢 01	AAA	2.15%
327D(休 2)	137843.SH	22 首钢 01	AAA	2.15%
327D(休 2)	137843.SH	22 首钢 01	AAA	2.15%
328D(休 1)	175173.SH	G20 洪轨 1	AAA	2.16%
354D	148083.SZ	22 东莞 02	AA+	2.14%
357D+2Y	152612.SH	20 湘速 02	AAA	2.15%
358D+2Y	137945.SH	22 蓉产 02	AAA	2.21%
1.02Y+3Y	252871.SH	23 曹国 04	AA+	2.87%
1.05Y+2Y	137841.SH	22 温岭 02	AA+	2.30%
1.05Y+2Y	148127.SZ	22 中证 10	AAA	2.20%
1.17Y+5Y(休 1)	2023021.IB	20 中邮人寿 02	AAA	2.30%
1.28Y(休 2)	148179.SZ	23 国证 02	AAA	2.10%
1.32Y+2Y(休 1)	138864.SH	23 金茂 01	AAA	2.74%
1.39Y	250438.SH	23 建控 01	AA/AAA	2.47%
1.4Y+5Y	2123004.IB	21 中邮人寿 01	AAA	2.33%
1.42Y+5Y(休 1)	2123007.IB	21 阳光人寿	AAA	2.80%
1.46Y+2Y	148241.SZ	23 粤科 01	AAA	2.27%
1.46Y+2Y	148241.SZ	23 粤科 01	AAA	2.27%
1.46Y+2Y	148241.SZ	23 粤科 01	AAA	2.27%
1.48Y+2Y	250814.SH	23 滁城 03	AA+	2.30%
1.64Y+NY	188270.SH	21 中铁 Y4	AAA	2.30%
1.64Y+2Y	250968.SH	23 宜昌 01	AA+	2.30%
1.64Y+2Y	250968.SH	23 宜昌 01	AA+	2.30%
1.74Y(休 1)	251693.SH	23 渝铝 02	AA	2.73%
1.75Y	115679.SH	23 安信 G1	AAA	2.17%
1.75Y	133052.SZ	21 桂铁 02	AAA	2.40%
1.79Y	188568.SH	21 招证 10	AAA	2.17%
1.79Y	188568.SH	21 招证 10	AAA	2.17%
1.81Y	252032.SH	23 海陵 01	AA+	2.50%
1.88Y+2Y	252321.SH	23 潆川 01	AA+	2.50%
2.26Y+2Y	240536.SH	24 神木 01	AA+	2.52%
2.33Y	240590.SH	24 首集 K1	AAA	2.42%
2.45Y+2Y	184328.SH	22 建德 G2	AA/AAA	2.46%
2.5Y+2Y(休 1)	254671.SH	24 津港 01	AAA	2.70%
2.55Y(休 2)	240985.SH	24 金港 G1	AA+	2.41%
2.58Y+2Y(休 1)	133848.SZ	24 漳资 01	AA+	2.58%
2.58Y	241056.SH	24 义乌 G2	AAA	2.32%
2.65Y	241166.SH	GK 国能 02	AAA	2.23%
2.73Y	241313.SH	24 上金 K1	AAA	2.38%
2.73Y	241313.SH	24 上金 K1	AAA	2.38%
2.73Y	241313.SH	24 上金 K1	AAA	2.38%
2.74Y	194678.SH	22 泉港 01	AA	2.46%
2.85Y+2Y(休 1)	255751.SH	24 渝合 03	AA+	2.77%
2.85Y+2Y(休 1)	255751.SH	24 渝合 03	AA+	2.77%
2.87Y(休 2)	148904.SZ	24 绿发 02	AAA	2.76%
2.92Y+2Y	241700.SH	24 通城 03	AAA	2.34%
2.98Y+2Y(休 2)	184602.SH	22 洪产 02	AA+/AAA	2.44%
3.58Y+2Y(休 1)	115395.SH	23 兴卢 02	AA+	2.60%
4Y	240085.SH	23 山能 K2	AAA	2.50%
4.37Y(休 1)	240651.SH	24 兴城 02	AAA	2.51%
4.43Y	240685.SH	24 江开 G1	AAA	2.54%
4.46Y(休 1)	148682.SZ	24 路桥 K2	AAA	2.54%
4.72Y+NY	241216.SH	鄂交 YK04	AAA	2.55%
4.72Y+NY	241216.SH	鄂交 YK04	AAA	2.55%

4.92Y	148931.SZ	24 深业 03	AAA	2.54%
9.54Y(休 2)	240984.SH	24 济建 G2	AAA	2.95%
9.56Y(休 2)	241017.SH	24 葛洲 K2	AAA	2.62%
184D	032400727.IB	24 靖江滨江 PPN001(资产担保)	AA	2.41%
255D	032380639.IB	23 建德国资 PPN003	AA	2.43%
255D	032380639.IB	23 建德国资 PPN003	AA	2.43%
256D	032480706.IB	24 海尔租赁 PPN002	AAA	2.77%
288D+2Y	032280711.IB	22 镇江城建 PPN006	AA+	2.44%
306D+3Y	032380822.IB	23 鹰潭国控 PPN002	AA+	2.50%
1.07Y	032300538.IB	23 沛县国资 PPN008	AA	2.50%
1.07Y	032300538.IB	23 沛县国资 PPN008	AA	2.50%
2Y+2Y	032381021.IB	23 南阳投资 PPN001	AA+	2.52%
2Y+2Y	032381021.IB	23 南阳投资 PPN001	AA+	2.52%
2.45Y	032480337.IB	24 临空港投 PPN002	AA+	2.57%
13D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.06%
15D+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	1.84%
15D	2128037.IB	21 民生银行 01	AAA	1.90%
25D+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA	1.90%
39D	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	1.83%
39D	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	1.83%
39D	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	1.83%
39D	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	1.83%
44D+NY	1928036.IB	19 中信银行永续债	AAA	2.05%
44D+NY	1928036.IB	19 中信银行永续债	AAA	2.05%
44D+NY	1928036.IB	19 中信银行永续债	AAA	2.05%
59D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.12%
59D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.10%
59D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.10%
59D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.10%
63D+5Y(休 1)	1920091.IB	19 南京银行二级	AAA	2.03%
137D	2228019.IB	22 兴业银行 01	AAA	1.95%
141D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.09%
141D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.09%
155D+NY	2020016.IB	20 江苏银行永续债	AAA	2.14%
182D	2228028.IB	22 中信银行 01	AAA	1.98%
182D	2228028.IB	22 中信银行 01	AAA	1.98%
190D+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.09%
228D	2220045.IB	22 宁波银行 03	AAA	2.00%
228D	2220045.IB	22 宁波银行 03	AAA	2.00%
244D+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.25%
244D+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.26%
254D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.155%
254D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.155%
254D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.155%
254D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.155%
254D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.155%
279D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.13%
279D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.13%
279D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.13%
279D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.13%
279D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.13%
281D	2228046.IB	22 中信银行 02	AAA	1.99%
281D	2228046.IB	22 中信银行 02	AAA	1.99%
290D+5Y	2028024.IB	20 中信银行二级	AAA	2.13%
321D+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.12%
324D+5Y	2028034.IB	20 浦发银行二级 03	AAA	2.14%
329D+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.17%
331D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.12%
356D(休 1)	2228051.IB	22 平安银行小微债	AAA	2.02%
1.02Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.18%
1.05Y+NY	2028048.IB	20 中国银行永续债 02	AAA	2.17%
1.07Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.18%
1.07Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.18%
1.07Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.18%
1.07Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.18%
1.07Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.18%
1.07Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.18%
1.49Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.26%
1.49Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.26%
1.49Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.25%
1.49Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.25%

1.58Y+5Y	2120045.IB	21 青岛银行二级 02	AAA/AA+	2.34%
1.58Y+5Y	2120045.IB	21 青岛银行二级 02	AAA/AA+	2.34%
1.61Y+5Y(休 2)	2120047.IB	21 宁波银行二级 01	AAA	2.27%
1.78Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.24%
1.78Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.24%
1.82Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.24%
1.82Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.24%
1.88Y+5Y(休 2)	2121039.IB	21 成都农商二级 01	AAA	2.39%
1.92Y+5Y(休 2)	2128030.IB	21 交通银行二级	AAA	2.26%
1.99Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	2.29%
1.99Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	2.29%
1.99Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	2.29%
1.99Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	2.29%
2Y	212380022.IB	23 华夏银行债 04	AAA	2.14%
2Y	212380022.IB	23 华夏银行债 04	AAA	2.13%
2.08Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.28%
2.08Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA	2.32%
2.08Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA	2.32%
2.08Y+5Y	2120105.IB	21 厦门银行二级 02	AAA/AA+	2.39%
2.08Y+5Y	2120105.IB	21 厦门银行二级 02	AAA/AA+	2.37%
2.13Y+5Y(休 1)	2128049.IB	21 建设银行二级 05	AAA	2.27%
2.13Y+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	2.28%
2.21Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	2.31%
2.21Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	2.31%
2.21Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	2.30%
2.35Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	2.155%
2.35Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	2.15%
2.36Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.305%
2.36Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.305%
2.36Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.305%
2.36Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.305%
2.39Y	212480005.IB	24 光大银行债 01	AAA	2.17%
2.41Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02	AAA	2.17%
2.45Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	2.36%
2.45Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	2.36%
2.55Y	2420017.IB	24 杭州银行小微债	AAA	2.18%
2.55Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.31%
2.55Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.30%
2.64Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.315%
2.68Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.21%
2.7Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	2.17%
2.77Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	2.36%
2.79Y+1Y(休 2)	312410003.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.29%
2.82Y+5Y(休 1)	092280065.IB	22 工行二级资本债 03A	AAA	2.315%
2.82Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	2.37%
2.84Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	2.36%
2.91Y	212480020.IB	24 中山农商行债 01	AA+	2.39%
2.91Y	212480020.IB	24 中山农商行债 01	AA+	2.39%
2.92Y+5Y	092280098.IB	22 杭州银行二级资本债 01	AAA	2.39%
2.92Y+5Y	092280098.IB	22 杭州银行二级资本债 01	AAA	2.37%
2.92Y+5Y	092280098.IB	22 杭州银行二级资本债 01	AAA	2.37%
3.03Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	2.30%
3.04Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.30%
3.05Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.33%
3.05Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.32%
3.12Y+5Y(休 1)	232280003.IB	22 成都银行二级资本债 01	AAA	2.51%
3.17Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.52%
3.17Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.52%
3.17Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.52%
3.17Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.52%
3.17Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.52%
3.42Y+5Y	232380009.IB	23 建行二级资本债 01A	AAA	2.36%
3.63Y+NY	242380008.IB	23 中行永续债 01	AAA	2.44%
3.82Y+5Y	232380033.IB	23 成都银行二级资本债 01	AAA	2.60%
3.83Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.46%
3.83Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.455%
4.01Y+NY	242380023.IB	23 徽商银行永续债 01	AAA	2.68%
4.05Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	2.41%
4.09Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.49%
4.09Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.49%
4.26Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	2.43%
4.26Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	2.43%

4.49Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.52%
4.49Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.52%
4.49Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.52%
4.49Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.43%
4.5Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.43%
4.56Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.495%
4.6Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.50%
4.6Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.50%
4.62Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.575%
4.62Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.57%
4.62Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.565%
4.62Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.56%
4.62Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.55%
4.7Y+5Y	232480032.IB	24 兴业银行二级资本债 02	AAA	2.50%
4.7Y+5Y	232480032.IB	24 兴业银行二级资本债 02	AAA	2.50%
4.7Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.555%
4.7Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.54%
4.7Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.51%
4.7Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.51%
4.7Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.50%
4.7Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.505%
4.78Y+5Y	232480050.IB	24 上海银行二级资本债 01	AAA	2.52%
4.78Y+5Y	232480050.IB	24 上海银行二级资本债 01	AAA	2.52%
4.79Y+5Y(休 2)	232400034.IB	24 杭州银行二级资本债 01	AAA	2.54%
4.8Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.495%
4.83Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.505%
4.83Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.50%
4.84Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.435%
4.84Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.435%
4.84Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.43%
9.49Y+5Y	232480012.IB	24 农行二级资本债 02B	AAA	2.51%
9.49Y+5Y	232480012.IB	24 农行二级资本债 02B	AAA	2.51%
9.77Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA	2.705%
9.77Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA	2.70%

文 / Derek Huang, Liyuan Zhong, Austin Lin

联系人：Xiaoting Bu
邮箱：Xiaoting.Bu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明：
以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和／或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

禁止处理涉密信息和内部敏感信息
禁止处理涉密信息和内部敏感信息