



【2024-10-17】

国债

央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，10月17日以固定利率、数量招标方式开展了1326亿元7天期逆回购操作，操作利率1.50%。Wind数据显示，当日1500亿元逆回购和700亿元国库现金定存到期。

国债方面 281D 240015 1.42-1.45； 2.83Y 240016 1.58-1.6275； 4.74Y 240014 1.755-1.7925； 6.69Y 240013 1.965-2.00； 9.61Y 240011 2.095-2.125； 29Y 230023 2.2625-2.295。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.4425	1.6200	1.8000	1.9975	2.1225	2.3050
今日国债(%)	1.4200	1.5800	1.7600	1.9650	2.0950	2.2710
变动(%)	-0.0225	-0.0400	-0.0400	-0.0325	-0.0275	-0.0340

金融债

金融债方面 281D 240421 1.69-1.70； 4.35Y 240203 1.845-1.87； 6.01Y 200215 2.01-2.03； 9.71Y 240420 2.2025-2.225。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.6700	1.8025	1.9100	2.1700	2.2275
今日非国开金融债(%)	1.6700	1.7900	1.8800	2.1700	2.2050
变动(%)	0.0000	-0.0125	-0.0300	0.0000	-0.0225
昨日国开债(%)	1.6800	1.7950	1.8750	2.0900	2.2060
今日国开债(%)	1.7000	1.7750	1.8455	2.0650	2.1775
变动(%)	0.0200	-0.0200	-0.0295	-0.0250	-0.0285

短期融资券

今日银行间短融市场交投较活跃，成交主要集中于Q4期限。短端方面，26D 012483241.IB 24 锡交通 SCP009 AAA 在2.00%成交（估值-3位置），银行出给基金；70D 012482595.IB 24 中交上航 SCP004(科创票据) AAA 在2.02%成交（估值-2位置），基金出给基金。中长端方面，96D 012481462.IB 24 悦达 SCP006 AAA 在2.30%成交（估值-4位置），银行出给基金；151D 012481910.IB 24 江西交投 SCP004 AAA 在2.00%成交（估值位置），基金出给基金。长端方面，191D(休2) 042480249.IB 24 滨建投 CP002 AAA 在2.37%成交（估值位置），基金出给基金；307D 042480490.IB 24 电网 CP024 AAA 在1.98%成交（估值+1位置），银行出给理财。总体而言，短端、中长端和长端收益日内均保持震荡下行。

	评级	1M	3M	6M	9M	12M
绝对收益率	AAA	1.97	2	2.02	2	2.01
	AA+	1.98	2.03	2.18	2.09	2.18
	AA	2.15	2.05	2.15	2.18	2.2
	AA-	2.08	2.23	2.16	2.2	2.2

与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	1.94	3	1.99	1	2.02	0	2	0	2.02	-1
	AA+	1.96	2	2.1	-7	2.11	7	2.09	0	2.2	-2
	AA	2.05	10	2.08	-3	2.15	0	2.13	5	2.16	4
	AA-	2.1	-2	2.3	-7	2.2	-4	2.22	-2	2.34	-14

中期票据

今日中票交投情绪平淡，1-3 年短端中票，22 晋能煤业 MTN026（AAA，1.03Y）在 2.20%低估值 4bp 的位置成交；23 深圳高速 MTN001（AAA，1.60Y）在 2.07%低估值 1bp 位置成交；24 宝钢 MTN001(科创票据)（AAA，1.88Y）在 2.13%低估值 1bp 位置成交；3 到 5 年期限，19 北控水务 MTN001B（AAA，4.24Y）在 2.28%低估值 2bp 位置成交；24 汇金 MTN003（AAA，4.59Y）成交在 2.25%，高估值 1bp 的位置；24 南电 MTN007（AAA，4.77Y）成交在 2.22%，低估 2bp 位置。5Y 及以上期限，24 亦庄投资 MTN002B（AAA，9.67Y）在 2.75%低估值 1bp 的位置成交；24 中石油 MTN002（AAA，9.74Y）成交在 2.43%，低估值 3bp 的位置。总体而言，今日中票收益下行。

	评级	1y	3y	5y	7y				10y	
绝对收益率	AAA+	2.01	2.13	2.25	2.44				None	
	AAA	2.15	2.24	2.43	None				None	
	AA+	2.28	2.4	2.6	None				None	
	AA	2.4	2.53	2.95	None				None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.021	2.141	2.261	2.46		-2		None	None
	AAA	2.161	2.251	2.452	None		None		None	None
	AA+	2.313	2.422	2.633	None		None		None	None
	AA	2.433	2.563	2.983	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，23 中证 G4 AAA 成交在 1.98%。23 信投 G4 AAA 成交在 2.08%，券商卖出，基金买入。19 国投 04 AAA 成交在 2.25%。城投方面，22 赣发 01 AAA 成交在 2.22%，券商卖出，基金买入。22 嘉善债 01 AA+ 成交在 2.35%，基金卖出，基金买入。24 衡城 01 AA+ 成交在 2.87%，券商资管卖出，券商买入。长端方面，24 中化 06 AAA 成交在 2.68%。24 山高 01 AAA 成交在 2.71%。24 蜀道 04 AAA 成交在 2.72%。

银行债

今日银行债成交较为活跃，全天成交在估值-13 到估值-3，买盘强势，收盘成交在估值-2。成交以 4-5Y 的大行二永为主。商金债成交主要分布于股份行和城商行。5Y 方面，大行二永早盘成交在估值附近，后一路 TKN 行情，成交回落于估值-1 附近。午后开盘，市场买方情绪比较高涨，买方一路 TKN，午后成交从估值-1 到估值-3，后尾盘收益率收盘于估值-2，。24 工行二级资本债 01A（4.88Y）今日在 2.29%（估值-1）随后一度行至 2.48%（-2），收盘到 2.275（估值-2.6）基金出给基金和理财。24 交行永续债 01BC（4.88Y）今日在 2.36（-0）成交多笔，一路 TKN 到 2.345（-1.5）2.44（-2）2.335（-2.5）券商 出给 券商资管和券商。短端今日成交较为活跃，基金和券商出给基金。20 中国银行二级 01（360D+5Y）在 2.05%（0）成交多笔，理财出给基金。商金方面，今日成交较少，24 南京银行 01·（2.69Y）成交活跃，成交在 2.09%，2.08%基金，银行和券商参与双边。

美元债

周四各版块表现差异较大。金融板块，浮息债卖盘不减，买盘较前几日有所减弱。城投板块，投资者风险偏好明显加强，8%以上美元、点心城投买盘大幅增加，而卖盘愈发惜售。地产板块，受政策消息影响，万科、龙湖、新城等下跌 1-2pt。

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
8D	012480622.IB	24 张江集 SCP001	AAA	1.97%
8D	042380720.IB	23 南京滨江 CP002	AA+	2.17%
8D	012480622.IB	24 张江集 SCP001	AAA	1.97%
11D	012480446.IB	24 即墨城投 SCP001	AA+	2.20%
26D	012483241.IB	24 锡交通 SCP009	AAA	2.00%
26D	012483241.IB	24 锡交通 SCP009	AAA	2.00%

26D	012483241.IB	24 锡交通 SCP009	AAA	2.00%
33D	012482511.IB	24 航天电子 SCP008	AA+	2.10%
57D	012483299.IB	24 沪电力 SCP018	AAA	1.95%
57D	012483299.IB	24 沪电力 SCP018	AAA	1.95%
70D	012482595.IB	24 中交上航 SCP004(科创票据)	AAA	2.02%
81D	012481249.IB	24 光大集团 SCP001	AAA	1.95%
84D	072410113.IB	24 光大证券 CP001	AAA	1.94%
88D	012481328.IB	24 复星高科 SCP001	AAA	4.75%
90D	012481898.IB	24 国网租赁 SCP015	AAA	2.09%
90D	012481898.IB	24 国网租赁 SCP015	AAA	2.09%
95D	012483250.IB	24 粤科金融 SCP002	AAA	2.09%
96D	012481462.IB	24 悦达 SCP006	AAA	2.30%
96D	012481462.IB	24 悦达 SCP006	AAA	2.30%
97D	042480044.IB	24 鄂联投 CP001	AAA	2.15%
127D	072410131.IB	24 平安证券 CP010	AAA	1.97%
134D	012482035.IB	24 象屿 SCP003	AAA	2.20%
138D	012481785.IB	24 连云城建 SCP001	AA+	2.28%
176D	072410163.IB	24 浙商证券 CP003	AAA	2.01%
176D	012482465.IB	24 湖北宏泰 SCP002	AAA	2.26%
180D	072410172.IB	24 平安证券 CP013	AAA	1.99%
180D	072410172.IB	24 平安证券 CP013	AAA	1.99%
191D(休 2)	042480249.IB	24 滨建投 CP002	AAA	2.37%
191D(休 2)	042480249.IB	24 滨建投 CP002	AAA	2.37%
191D(休 2)	042480249.IB	24 滨建投 CP002	AAA	2.37%
192D(休 1)	012482323.IB	24 兴化城投 SCP004	AA	2.32%
194D	042480252.IB	24 高淳建设 CP005	AA	2.36%
218D	012482576.IB	24 宏桂资本 SCP001	AA+	2.50%
231D	072410136.IB	24 开源证券 CP001	AAA	2.13%
246D	012483146.IB	24 青岛海控 SCP004	AAA	2.20%
248D(休 1)	012483193.IB	24 爱尔医疗 SCP002	AA+	2.55%
248D(休 1)	012483193.IB	24 爱尔医疗 SCP002	AA+	2.55%
307D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.98%
307D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.98%
364D	072410180.IB	24 东兴证券 CP005	AAA/A-1	2.04%
364D	072410180.IB	24 东兴证券 CP005	AAA/A-1	2.04%

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
10D(休 1)	102102151.IB	21 福州建工 MTN001	AA	2.45%
32D	102103011.IB	21 招商蛇口 MTN001A	AAA	1.97%
40D+NY	102103108.IB	21 余姚城投 MTN003	AA+	2.23%
49D	101901658.IB	19 龙城投资 MTN001	AAA	2.10%
49D	101901658.IB	19 龙城投资 MTN001	AAA	2.10%
53D+NY	102103211.IB	21 华电江苏 MTN002	AAA	2.14%
53D+NY	102103211.IB	21 华电江苏 MTN002	AAA	2.14%
78D	102000007.IB	20 南通汽运 MTN001	AA/AAA	2.30%
82D	102000003.IB	20 苏轨交 MTN001	AAA	2.05%
84D	102000016.IB	20 庐江城投 MTN001	AA/AAA	2.15%
84D	102000016.IB	20 庐江城投 MTN001	AA/AAA	2.15%
85D	102000021.IB	20 宜昌城投 MTN001	AA+	2.13%
85D	102000021.IB	20 宜昌城投 MTN001	AA+	2.13%
85D	102000021.IB	20 宜昌城投 MTN001	AA+	2.13%
88D	102100042.IB	21 长沙高新 MTN001A	AA+	2.14%
88D	102100042.IB	21 长沙高新 MTN001A	AA+	2.14%
88D	102100042.IB	21 长沙高新 MTN001A	AA+	2.14%
128D+1Y(休 1)	102380256.IB	23 国惠投资 MTN001A	AAA	2.20%
141D	102280433.IB	22 昌平科技 MTN001	AA/AA+	2.25%
143D+3Y	102380425.IB	23 乌城轨 MTN001	AA+	2.33%
150D(休 1)	102280521.IB	22 晋能煤业 MTN003	AAA	2.15%
151D+NY	102380577.IB	23 江宁城建 MTN002	AAA	2.30%
157D(休 1)	102000460.IB	20 铁建房产 MTN002	AAA	2.28%
161D+NY	102380694.IB	23 首旅 MTN003	AAA	2.28%
185D+3Y	102380989.IB	23 新乡投资 MTN001	AA+	2.28%
186D	102000749.IB	20 临淄公有 MTN001	AA	2.95%
187D	102280876.IB	22 巴州国信 MTN001	AA+	2.35%
187D	102280911.IB	22 红豆 MTN002	AA+/AAA	2.60%
192D(休 1)	102000813.IB	20 南部新城 MTN001	AA+	2.42%
193D	102000874.IB	20 首旅 MTN002	AAA	2.10%
200D(休 1)	102281047.IB	22 昌平科技 MTN002	AA/AA+	2.21%
204D	102281059.IB	22 高淳经开 MTN003	AA	2.30%
217D	102001046.IB	20 建发地产 MTN001	AAA	2.27%

248D+NY(休 1)	102200170.IB	22 建发集 MTN003	AAA	2.33%
248D+2Y	102281351.IB	22 金阳新城 MTN002	AA+	2.33%
250D	102281380.IB	22 溧水产投 MTN001	AA	2.32%
250D	102281380.IB	22 溧水产投 MTN001	AA	2.32%
254D+2Y	102281422.IB	22 江东控股 MTN002	AA+	2.19%
266D	102300395.IB	23 潍坊城建 MTN002	AAA	2.40%
317D(休 2)	102281972.IB	22 乌经开 MTN002	AA+	2.36%
318D(休 1)	102281988.IB	22 青岛啤酒 MTN001	AAA	2.03%
361D+2Y	102282231.IB	22 金阳新城 MTN003	AA+	2.35%
1.03Y	102282387.IB	22 晋能煤业 MTN026	AAA	2.20%
1.06Y(休 2)	102383018.IB	23 海安城建 MTN001	AA+	2.30%
1.07Y+2Y	102282502.IB	22 丽水国资 MTN001	AA+	2.23%
1.12Y	102282592.IB	22 湛江交投 MTN002	AA+	2.20%
1.16Y+NY(休 1)	102383350.IB	23 青岛国信 MTN008	AAA	2.30%
1.33Y(休 1)	102380195.IB	23 思明国控 MTN002	AA	2.36%
1.34Y(休 6)	102380224.IB	23 连云港 MTN001	AA+	2.40%
1.35Y+1Y	102480519.IB	24 光明房产 MTN001	AA+	2.99%
1.35Y+1Y	102480519.IB	24 光明房产 MTN001	AA+	2.99%
1.42Y	102380589.IB	23 安居建设 MTN001(保障性租赁住房)	AAA	2.26%
1.44Y(休 2)	102380716.IB	23 华润置地 MTN001A	AAA	2.35%
1.6Y(休 1)	102381220.IB	23 深圳高速 MTN001	AAA	2.07%
1.66Y	102101084.IB	21 首创置业 MTN002	AAA	3.18%
1.67Y	102101104.IB	21 衡阳城投 MTN001	AA+	2.25%
1.67Y	102101104.IB	21 衡阳城投 MTN001	AA+	2.25%
1.88Y	102483920.IB	24 宝钢 MTN001(科创票据)	AAA	2.13%
1.91Y+2Y	102382464.IB	23 苏州高技 MTN003	AAA	2.23%
1.91Y+2Y	102382474.IB	23 阜阳投资 MTN001	AA+	2.28%
2.02Y+2Y	102382814.IB	23 合川投资 MTN003	AA/AAA	2.58%
2.06Y+2Y	102382974.IB	23 襄阳住房 MTN001	AA+	2.27%
2.24Y	102480103.IB	24 青岛北城 MTN001	AA+	2.37%
2.28Y	102280220.IB	22 涪陵国资 MTN002B	AA+	2.30%
2.38Y	102480651.IB	24 富和建设 MTN002	AA	2.50%
2.4Y+NY(休 2)	102480845.IB	24 西安高新 MTN006	AAA	2.80%
2.42Y	102481019.IB	24 京汽集 MTN002	AAA	2.45%
2.42Y+NY(休 2)	102480988.IB	24 西安高新 MTN007	AAA	2.80%
2.44Y(休 1)	102481263.IB	24 昆山创业 MTN001	AAA	2.21%
2.67Y(休 1)	102482388.IB	24 建安投资 MTN001	AA+	2.46%
2.79Y	102483303.IB	24 湖南建设 MTN001	AAA	2.45%
2.8Y+NY	102483322.IB	24 湘高速 MTN010	AAA	2.27%
2.93Y	102400962.IB	24 国电 MTN004	AAA	2.15%
2.93Y+3Y	102001820.IB	20 久事 MTN003	AAA	2.17%
2.94Y	102484229.IB	24 上海电气 MTN002	AAA	2.35%
2.94Y	102484229.IB	24 上海电气 MTN002	AAA	2.35%
2.94Y(休 2)	102484279.IB	24 中电投 MTN023	AAA	2.15%
2.94Y(休 2)	102484279.IB	24 中电投 MTN023	AAA	2.16%
2.98Y(休 1)	102484307.IB	24 豫航空港 MTN021	AAA	2.73%
2.98Y(休 1)	102484307.IB	24 豫航空港 MTN021	AAA	2.73%
2.99Y	102484389.IB	24 国能新能 MTN004	AAA	2.21%
3.84Y(休 1)	102483618.IB	24 云能投 MTN019	AAA	3.20%
4.24Y	101900030.IB	19 北控水务 MTN001B	AAA	2.28%
4.5Y	102481533.IB	24 东南国资 MTN001	AAA	2.35%
4.52Y	102400734.IB	24 通顺交投 MTN001	AA+	2.80%
4.59Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.25%
4.63Y	102482169.IB	24 赣州开投 MTN001	AA	3.23%
4.66Y	102482284.IB	24 济宁城投 MTN004	AA+	3.40%
4.75Y	102483085.IB	24 镇江交通 MTN002	AA+	2.78%
4.77Y	102483215.IB	24 南电 MTN007	AAA	2.22%
4.81Y	102483459.IB	24 中金岭南 MTN004	AA+	2.70%
4.85Y	102483701.IB	24 昆山高新 MTN004	AA+	2.47%
4.86Y(休 1)	102483757.IB	24 北排水 MTN002	AAA	2.28%
4.86Y(休 1)	102483757.IB	24 北排水 MTN002	AAA	2.28%
4.91Y	102484053.IB	24 陕有色 MTN004	AAA	2.47%
4.91Y	102484053.IB	24 陕有色 MTN004	AAA	2.47%
4.91Y(休 2)	102484286.IB	24 南电 MTN008	AAA	2.24%
4.92Y	102484121.IB	24 德州财金 MTN002	AA+	2.96%
4.93Y(休 1)	102484188.IB	24 京住总集 MTN003	AAA	2.46%
4.94Y	102484259.IB	24 浙嘉高新 MTN001	AAA	2.45%
9.67Y(休 1)	102400816.IB	24 亦庄投资 MTN002B	AAA	2.75%
9.74Y(休 2)	102483017.IB	24 中石油 MTN002	AAA	2.43%
9.75Y(休 1)	102483033.IB	24 华为 MTN001	AAA	2.54%
9.85Y	102483710.IB	24 越秀集团 MTN006A	AAA	2.58%

9.86Y(休 2)	102483759.IB	24 中国航材 MTN001	AAA	2.65%
9.86Y(休 2)	102483759.IB	24 中国航材 MTN001	AAA	2.65%
9.87Y	102483888.IB	24 临沂城投 MTN003B	AAA	3.39%
29.8Y	102483342.IB	24 中化股 MTN004	AAA	2.81%

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
19D	196545.SH	21 运投 01	AA+	2.45%
19D	196545.SH	21 运投 01	AA+	2.45%
26D+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	2.00%
26D+2Y	197560.SH	21 章控 03	AA+	2.38%
35D	031900844.IB	19 宜宾国资 PPN003	AAA	2.10%
36D+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA	2.00%
39D+2Y	184130.SH	21 日港 01	AAA	2.15%
40D	163010.SH	19 浦集 02	AAA	1.95%
43D	032191331.IB	21 圆山发展 PPN001	AA	2.41%
43D	032191331.IB	21 圆山发展 PPN001	AA	2.41%
46D+2Y	149727.SZ	21 泸发展	AA/AAA	2.35%
47D	185083.SH	21 国新 04	AAA	1.99%
49D	162621.SH	19 常德 01	AA+	2.21%
53D	197833.SH	21 安信 04	AAA	1.95%
53D	197833.SH	21 安信 04	AAA	1.96%
63D+5Y	190311.IB	19 进出 11	估值:2.06/2.4857	2.05%
71D	1780417.IB	17 金华融盛债	AA/AA+	2.30%
71D	162848.SH	19 冶投 02	AA	3.04%
92D	032280092.IB	22 泰州海陵 PPN002	AA+	2.45%
100D(休 2)	185350.SH	22 宁港 01	AAA	2.11%
131D	2220012.IB	22 浙商银行小微债 01	AAA	1.96%
135D(休 2)	2228016.IB	22 华夏银行 01	AAA	1.98%
135D(休 2)	2228016.IB	22 华夏银行 01	AAA	2.00%
135D(休 2)	185436.SH	22 产融 01	AAA	2.13%
136D+1Y	032380164.IB	23 荥阳城投 PPN001	AA	2.47%
137D	152402.SH	20 鄂交 01	AAA	2.10%
139D+NY	163942.SH	20 新际 Y1	AAA	2.08%
148D+2Y(休 1)	185522.SH	22 中保 01	AAA	2.07%
158D	163317.SH	20 首集 01	AAA	2.09%
163D(休 2)	185585.SH	22 镇投 G1	AA+	2.29%
163D+NY(休 2)	149864.SZ	22 穗环 G1	AAA	2.14%
175D	241124.SH	24 招 S14	AAA	1.97%
179D	133234.SZ	22 国海 01	AAA	2.07%
185D(休 1)	185517.SH	22 诚通 K1	AAA	2.04%
187D+2Y	032280438.IB	22 渝惠通 PPN001	AA+	2.43%
191D(休 2)	032400730.IB	24 兴化国投 PPN001(资产担保)	AA+	2.48%
199D+3Y	251013.SH	23 交旅 02	AA	2.63%
203D	254714.SH	24 渝合 D1	AA+	2.45%
207D+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.06%
207D+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.07%
216D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.04%
216D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.05%
221D	163564.SH	20 渝开 02	AA+	2.32%
221D+2Y	185806.SH	22 紫金 02	AAA	2.08%
237D	032000519.IB	20 衡阳城投 PPN003	AA+	2.28%
237D	032000519.IB	20 衡阳城投 PPN003	AA+	2.25%
238D+1Y	115475.SH	23 国都 G1	AA+	2.39%
255D+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.15%
255D+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.15%
255D+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.15%
261D+1Y(休 1)	115594.SH	23 象地 01	AA+/AAA	2.79%
261D(休 2)	251636.SH	23 淮控 02	AA	2.70%
265D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.075%
265D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.075%
265D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.07%
282D(休 2)	137555.SH	22 海通 04	AAA	2.02%
295D+1Y(休 2)	251974.SH	23 联储一	AA	2.80%
296D+2Y	148015.SZ	22 广电 01	AAA	2.06%
303D(休 2)	127843.SH	PR 新宇 02	AA-	5.10%
339D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.05%
339D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.05%
340D+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.10%
342D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.04%
342D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.06%

343D+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.08%
344D	137847.SH	22 国都 C1	AA+/AAA	2.34%
346D+5Y(休 2)	2020065.IB	20 徽商银行二级 01	AAA	2.095%
1Y	148085.SZ	22 广发 C1	AAA	2.05%
1Y(休 2)	148087.SZ	22 国信 06	AAA	2.01%
1Y(休 2)	148087.SZ	22 国信 06	AAA	2.02%
1.01Y(休 1)	2228051.IB	22 平安银行小微债	AAA	1.97%
1.01Y+2Y	152612.SH	20 湘速 02	AAA	2.11%
1.01Y+2Y	152612.SH	20 湘速 02	AAA	2.11%
1.02Y(休 2)	032300516.IB	23 武进绿建 PPN003	AA	2.40%
1.02Y(休 1)	167925.SH	20 邵东 01	AA	3.10%
1.02Y+2Y	133342.SZ	22 赣发 01	AAA	2.22%
1.02Y(休 1)	167925.SH	20 邵东 01	AA	3.10%
1.03Y	252820.SH	23 荷开 03	AA/AA+	2.60%
1.03Y	252820.SH	23 荷开 03	AA/AA+	2.60%
1.05Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.07%
1.07Y	175401.SH	20 华发 04	AAA	2.70%
1.08Y(休 2)	032381072.IB	23 淮南经发 PPN002	AA	2.70%
1.08Y+NY	2028048.IB	20 中国银行永续债 02	AAA	2.105%
1.08Y+NY	2028048.IB	20 中国银行永续债 02	AAA	2.105%
1.09Y+5Y	092000013.IB	20 信达二级资本债 01	AAA	2.23%
1.09Y+5Y	092000013.IB	20 信达二级资本债 01	AAA	2.23%
1.1Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.10%
1.1Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.11%
1.1Y+NY	2028052.IB	20 恒丰银行永续债	AAA	2.40%
1.1Y+NY	2028052.IB	20 恒丰银行永续债	AAA	2.41%
1.19Y	1880331.IB	18 泰华诚债	AA/AA+	2.57%
1.2Y+5Y(休 1)	200219.IB	20 国开 19	估值:2.07/2.4218	2.06%
1.27Y	253485.SH	24 华远 01	AA/AAA	2.95%
1.28Y+3Y	240556.SH	24 山钢 01	AAA	2.34%
1.43Y	175887.SH	21 长发 02	AAA	2.18%
1.52Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.15%
1.52Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.16%
1.58Y	212380005.IB	23 光大银行债 01	AAA	2.00%
1.58Y	212380005.IB	23 光大银行债 01	AAA	2.00%
1.59Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	2.15%
1.59Y	188128.SH	21 国君 G4	AAA	2.05%
1.6Y+2Y	115386.SH	23 上证 01	AAA	2.13%
1.65Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.15%
1.68Y(休 1)	032100669.IB	21 诸暨新城 PPN001	AA	2.41%
1.73Y(休 1)	251549.SH	23 益航 01	AAA	2.77%
1.76Y	188393.SH	21 东莞 01	AA+	2.24%
1.76Y	032480732.IB	24 昆明安居 PPN006	AA+	3.57%
1.78Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.02%
1.78Y	115722.SH	23 信投 C6	AAA	2.19%
1.79Y	032380714.IB	23 溪口旅游 PPN001(资产担保)	AA	2.40%
1.79Y	032380714.IB	23 溪口旅游 PPN001(资产担保)	AA	2.40%
1.79Y	251959.SH	23 武发 02	AA+	2.37%
1.81Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.11%
1.81Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.11%
1.81Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.12%
1.84Y+2Y	251972.SH	23 苏水 01	AA/AA+	2.65%
1.87Y(休 2)	1980264.IB	19 国兴债 02	AA+	2.27%
1.9Y	2321029.IB	23 东莞农商小微债 01	AAA	2.05%
1.95Y+5Y(休 2)	2128030.IB	21 交通银行二级	AAA	2.12%
1.95Y+5Y(休 2)	2128030.IB	21 交通银行二级	AAA	2.12%
2Y	115985.SH	23 信投 G4	AAA	2.08%
2.01Y+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	2.22%
2.02Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	2.15%
2.02Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	2.15%
2.08Y+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	2.12%
2.08Y	136819.SH	16 川发 01	AAA	2.16%
2.11Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.18%
2.11Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.24%
2.11Y+2Y	032381106.IB	23 江津华信 PPN002	AA+	2.50%
2.16Y+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	2.21%
2.17Y	253404.SH	23 赣振 02	AA/AAA	2.40%
2.24Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	2.175%
2.25Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	2.18%
2.26Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	2.16%
2.27Y+6Y(休 1)	253753.SH	24 知投 01	AAA	2.27%
2.27Y(休 2)	240519.SH	24 信投 G1	AAA	2.10%

2.27Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.13%
2.28Y	149796.SZ	22 龙城 02	AAA	2.30%
2.29Y(休 1)	032480103.IB	24 伊犁财通 PPN001	AA+	2.44%
2.36Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	2.165%
2.38Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	2.04%
2.42Y	2080047.IB	20 雪浪债	AA/AA+	2.54%
2.5Y+2Y	032480406.IB	24 合川城投 PPN002	AA+	2.75%
2.5Y(休 2)	032480402.IB	24 蚌埠中城 PPN001	AA+	2.50%
2.52Y(休 1)	148722.SZ	24 国元 02	AAA	2.15%
2.59Y	252400001.IB	24 交银金租债 02	AAA	2.19%
2.67Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.175%
2.67Y(休 1)	212400006.IB	24 北京农商行债 01	AAA	100
2.68Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	2.16%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.0875%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.0875%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.0875%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.0875%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.0875%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.09%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.09%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.09%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.09%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.09%
2.71Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.10%
2.74Y	2420031.IB	24 苏州银行 01	AAA	2.10%
2.82Y+2Y	241462.SH	24 松国 01	AAA	2.21%
2.85Y+2Y	2280371.IB	22 嘉善债 01	AA+	2.35%
2.85Y+2Y	2280371.IB	22 嘉善债 01	AA+	2.35%
2.85Y+2Y	2280371.IB	22 嘉善债 01	AA+	2.35%
2.85Y+2Y	2280371.IB	22 嘉善债 01	AA+	2.35%
2.85Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	2.06%
2.87Y+1Y	312410005.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)	AAA	2.17%
2.88Y+NY(休 1)	092280086.IB	22 农行永续债 02	AAA	2.24%
2.93Y	2420044.IB	24 广州银行 01	AAA	2.10%
2.94Y	2420045.IB	24 东莞银行 02	AAA	2.10%
2.95Y+3Y	149647.SZ	21 青城 09	AAA	2.30%
2.95Y+2Y	184584.SH	G22 大足 1	AA/AA+	2.83%
3.02Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	2.19%
3.05Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	估值:2.19/2.539	2.19%
3.05Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	估值:2.19/2.539	2.19%
3.06Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	2.19%
3.06Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	2.21%
3.08Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.18%
3.2Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.38%
3.43Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	2.21%
3.45Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.43%
3.45Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.43%
3.45Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.43%
3.45Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.43%
3.45Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.43%
3.45Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.43%
3.49Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA	2.22%
3.49Y+5Y	232380017.IB	23 光大二级资本债 01A	AAA	2.26%
3.66Y+NY	242380008.IB	23 中行永续债 01	AAA	2.295%
3.73Y	152949.SH	21 扬庆 01	AA/AAA	2.36%
3.75Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	2.295%
3.75Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	2.305%
3.75Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	2.305%
3.76Y	115682.SH	23 京资 02	AAA	2.21%
3.83Y+NY	242380015.IB	23 成都农商行永续债 01	AAA	2.52%
3.86Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.33%
3.94Y+NY	242380021.IB	23 建行永续债 02	AAA	2.31%
4Y+NY	242380019.IB	23 邮储永续债 01	AAA	2.345%
4.02Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	2.27%
4.04Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA	2.27%
4.06Y	240192.SH	23 恒健 02	AAA	2.29%
4.08Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	2.27%
4.08Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	2.265%
4.3Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.605%
4.37Y	212480002.IB	24 建行债 01B	AAA	2.125%
4.42Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.34%

4.42Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.35%
4.42Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.35%
4.47Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.275%
4.47Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.49Y(休 1)	148682.SZ	24 路桥 K2	AAA	2.37%
4.52Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.39%
4.52Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.39%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.275%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.275%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.28%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	1980146.IB	19 鄂科投债 02	AAA	2.45%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.285%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.28%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.29%
4.53Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.54%
4.59Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.35%
4.59Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.36%
4.61Y+NY	242480003.IB	24 广州农商行永续债 01	AAA/AA+	2.63%
4.63Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.44%
4.63Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.335%
4.63Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.335%
4.65Y	241092.SH	24 铁工 K3	AAA	2.21%
4.65Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.42%
4.67Y	133864.SZ	24 衡城 01	AA+	2.87%
4.69Y	032480661.IB	24 衡阳城投 PPN002	AA+	2.71%
4.69Y	032480661.IB	24 衡阳城投 PPN002	AA+	2.71%
4.72Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.275%
4.72Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.275%
4.72Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.28%
4.72Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.28%
4.72Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.28%
4.72Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.28%
4.72Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.28%
4.72Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.29%
4.72Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.29%
4.73Y+5Y	232480032.IB	24 兴业银行二级资本债 02	AAA	2.35%
4.73Y+5Y	232400029.IB	24 中原银行二级资本债 01	AAA	2.80%
4.73Y+5Y	232400029.IB	24 中原银行二级资本债 01	AAA	2.80%
4.73Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.33%
4.73Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.345%
4.73Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.345%
4.75Y	032480717.IB	24 嵊州投资 PPN001	AA+	2.74%
4.78Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.34%
4.78Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.34%
4.78Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.34%
4.78Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.34%
4.8Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.37%
4.8Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.38%
4.8Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.38%
4.8Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.39%
4.81Y+NY	134007.SZ	24 晋投 Y2	AAA	2.66%
4.84Y+NY(休 1)	242400016.IB	24 民生银行永续债 01	AAA	2.60%
4.84Y+NY(休 1)	242400016.IB	24 民生银行永续债 01	AAA	2.60%
4.84Y+NY(休 1)	242400016.IB	24 民生银行永续债 01	AAA	2.60%
4.84Y+NY	242400018.IB	24 北京农商行永续债 01	AAA	2.60%
4.86Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.33%
4.86Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.345%
4.87Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.29%
4.9Y	134027.SZ	24 乌铁 01	AA+	2.80%
5.93Y+5Y	2028039.IB	20 中国银行二级 02	AAA	2.35%

5.93Y+5Y	2028039.IB	20 中国银行二级 02	AAA	2.35%
7.51Y+5Y	149891.SZ	22 粤高 02	AAA	2.41%
9.52Y(休 1)	240950.SH	24CHNG2K	AAA	2.46%

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