



【2023-08-18】

国债

央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，8月18日以利率招标方式开展了980亿元7天期逆回购操作，中标利率1.8%。Wind数据显示，当日20亿元逆回购到期，因此单日净投放960亿元；本周央行公开市场共有180亿元逆回购和4000亿元MLF到期，本周央行公开市场累计进行了7750亿元逆回购和4010亿元MLF操作，因此本周央行公开市场全口径净投放7580亿元。

国债方面 150D 230001 1.645，342D 230016 1.81，1.82Y 230013 2.0725-2.0825，2.74Y 230011 2.1825-2.19，4.66Y 230008 2.3575-2.36，6.6Y 230006 2.525-2.5325，9.77Y 230012 2.557-2.5675，29.66Y 230009 2.9125-2.9249

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.6400	2.1800	2.3600	2.4850	2.6050	2.9480
今日国债(%)	1.6450	2.1750	2.3500	2.4775	2.5975	2.9375
变动(%)	0.0050	-0.0050	-0.0100	-0.0075	-0.0075	-0.0105

金融债

金融债方面 143D 210202 1.80，338D(休1) 210406 2.00-2.01，1.82Y 230013 2.0725，1.82Y 230013 2.0825，2.4Y 230202 2.2675-2.28，3.83Y 220208 2.43 3.83Y 220208 2.44，4.4Y 230203 2.435-2.4475，6.83Y 200210 2.66-2.665，9.76Y 230210 2.666-2.68，18.22Y 210220 2.945-2.9475

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.8550	2.1800	2.4200	2.6250	2.7850
今日非国开金融债(%)	1.8300	2.1800	2.4200	2.6200	2.7750
变动(%)	-0.0250	0.0000	0.0000	-0.0050	-0.0100
昨日国开债(%)	1.6000	2.1500	2.4475	2.6100	2.7700
今日国开债(%)	1.6500	2.1450	2.4350	2.6000	2.7600
变动(%)	0.0500	-0.0050	-0.0125	-0.0100	-0.0100

短期融资券

今日短融交投情绪比较活跃，成交主要集中在各期限AAA AA+短融产品。短端方面，4D 012380660.IB 23 赣粤 SCP001 AAA 成交在2.00%位置，基金出给保险，88D 012380562.IB 23 鄂交投 SCP003 AAA 成交在2.11%位置，基金出给基金；中长端方面，104D 012380877.IB 23 武钢集 SCP003 AAA 成交在2.10%位置，券商出给基金，172D 012383073.IB 23 物产中大 SCP006 AAA 成交在2.31%位置，银行出给基金；长端方面，207D 012382276.IB 23 杭州交投 SCP001 AAA 成交在2.25%位置，双边均为基金，324D(银休1) 042380376 23 申能集 CP001 AAA 成交2.32%；总体而言，今日短融收益震荡。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	1.9		2.11		2.25		2.34		2.42	
	AA+	2.14		2.33		2.52		2.54		2.7	
	AA	2.69		2.85		3.08		3.47		3.71	
	AA-	3.16		3.88		3.98		4.45		4.44	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	1.92	-2	2.13	-2	2.23	2	2.3	4	2.41	1
	AA+	2.15	-1	2.32	1	2.5	2	2.55	-1	2.7	0
	AA	2.69	0	2.85	0	3.08	0	3.47	0	3.71	0
	AA-	3.16	0	3.88	0	3.98	0	4.45	0	4.44	0

中期票据

今日中票交投情绪较活跃。1-3年短端中票，在2.0Y和3.0Y附近较为集中，21 华能 MTN002(可持续挂钩) (AAA，1.27Y) 成交在2.35%；22 长电 MTN002A (AAA，1.56Y) 在2.43%成交；23 申迪 MTN002 (AAA，1.98Y) 在2.65%成交3笔；23 北控 MTN001 (AAA，2.60Y) 在2.75%成交6笔；21 中石化 MTN001 (AAA，2.94Y) 在2.58%成交。3到5年期限，成交一般，22 国新控股 MTN003(能源保供特别债) (AAA，4.11Y) 在2.88%成

交，与昨日持平；23 蜀道投资 MTN005（AAA，4.87Y）在 3.17%成交 2 笔。5Y 及以上期限，成交清淡，21 光大集团 MTN001B（AAA，7.98Y）在 3.10%成交；23 诚通控股 MTN003（AAA，9.99Y）在 3.52%成交。总体而言，今日中票收益率日内震荡，涨跌互现。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.24		2.64		2.86		3.11		None	
	AAA	2.38		2.84		3.17		3.29		None	
	AA+	2.61		3.11		3.59		None		None	
	AA	2.89		3.59		3.93		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.25	-1	2.64	0	2.87	-1	3.11	0	None	None
	AAA	2.38	0	2.85	-1	3.19	-2	3.3	-1	None	None
	AA+	2.61	0	3.1	1	3.59	0	None	None	None	None
	AA	2.9	-1	3.59	0	3.94	-1	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 广晟 KD AAA 成交在 2.40%。银行卖出，基金买入，23 穗投 02 AAA 成交在 2.87% 银行卖出，保险买入。城投方面，23 津投 13 成交在 4.50%，基金卖出，基金买入，甬交投 04 AAA 成交在 2.73%，银行卖出，理财买入。长端方面，23 穗投 02 AAA 成交在 2.87%，银行卖出，保险买入，23 国科 01 AAA 成交在 2.77% 银行卖出，基金买入。

美元债

投资级版块整体收窄 1-3bps，华融 HRINTH 整体跌 2pts，资产类名字卖压仍旧较重，信达 CCAMCL 27 成交在 6.2%附近。城投版块较昨日平淡，23-24 短券仍有买盘关注，ofr 仍旧稀缺。地产版块，碧桂园 COGARD 短券跌 0.5-1pts，新城 FTLNHD，路劲 ROADKG 等市场卖盘。

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
4D	012380660.IB	23 赣粤 SCP001	AAA	2.00%
4D	012380647.IB	23 物产中大 SCP003	AAA	2.05%
4D	012284063.IB	22 渝两江 SCP005	AAA	2.05%
5D	012380675.IB	23 国丰集团 SCP002	AAA	2.10%
5D	012381937.IB	23 华能 SCP012	AAA	2.00%
5D	012380707.IB	23 浙交投 SCP003	AAA	1.97%
5D	012381960.IB	23 大唐发电 SCP002	AAA	1.90%
11D	072310050.IB	23 中信建投 CP006	AAA	1.85%
18D	012380883.IB	23 三峡新能 SCP001	AAA	2.05%
24D	012382183.IB	23 江铜 SCP008(科创票据)	AAA	2.00%
26D	012381064.IB	23 凤凰传媒 SCP001	AAA	1.92%
31D	012382716.IB	23 华电股 SCP001	AAA	1.87%
32D	012382376.IB	23 高速路桥 SCP001	AAA	2.14%
32D	012381150.IB	23 浙江机场 SCP002	AAA	1.90%
33D	012382432.IB	23 龙源电力 SCP011	AAA	1.90%
33D	012382432.IB	23 龙源电力 SCP011	AAA	1.90%
40D	012382672.IB	23 伊利实业 SCP015	AAA	2.05%
52D	012380179.IB	23 桂交投 SCP002	AAA	2.20%
68D	012300262.IB	23 广州地铁 SCP004	AAA	2.05%
68D	012380576.IB	23 华发集团 SCP003	AAA	2.15%
69D	042280479.IB	22 大丰城建 CP001	AA+	2.50%
70D	012382832.IB	23 华能水电 SCP004	AAA	2.02%
80D	012382927.IB	23 江北建投 SCP005	AAA	2.16%
88D	012380562.IB	23 鄂交投 SCP003	AAA	2.11%
88D	012380562.IB	23 鄂交投 SCP003	AAA	2.11%
88D	012380562.IB	23 鄂交投 SCP003	AAA	2.11%
88D	012380562.IB	23 鄂交投 SCP003	AAA	2.11%
95D	012381984.IB	23 鲁高速股 SCP005	AAA	2.07%
96D	012382386.IB	23 龙盛 SCP008(科创票据)	AAA	2.38%
103D	012382056.IB	23 光明房产 SCP003	AA+	2.40%
104D	012380877.IB	23 武钢集 SCP003	AAA	2.10%
110D	012382933.IB	23 云投 SCP027	AAA	6.00%
110D	012382933.IB	23 云投 SCP027	AAA	6.00%
110D	012382933.IB	23 云投 SCP027	AAA	6.00%
117D	012382234.IB	23 闽能源 SCP002(碳资产)	AAA	2.15%
117D	012382234.IB	23 闽能源 SCP002(碳资产)	AAA	2.15%
117D	012382234.IB	23 闽能源 SCP002(碳资产)	AAA	2.15%
117D	012382234.IB	23 闽能源 SCP002(碳资产)	AAA	2.15%
117D	012382234.IB	23 闽能源 SCP002(碳资产)	AAA	2.15%
132D	012382969.IB	23 国药控股 SCP004	AAA	2.10%

132D	012382542.IB	23 中交一公 SCP004(科创票据)	AAA	100 净价
132D	012382542.IB	23 中交一公 SCP004(科创票据)	AAA	100 净价
133D	012383011.IB	23 中电路桥 SCP008	AAA	2.14%
133D	012383011.IB	23 中电路桥 SCP008	AAA	2.14%
137D	012381393.IB	23 济南高新 SCP002	AAA	2.37%
137D	012381393.IB	23 济南高新 SCP002	AAA	2.37%
150D	012381611.IB	23 西安高新 SCP004	AAA	2.43%
153D	012381952.IB	23 中核租赁 SCP002(绿色)	AA+	100 净价
154D	012381759.IB	23 浪潮电子 SCP004(科创票据)	AAA	2.28%
167D	042380059.IB	23 华阳新材 CP002	AAA	2.35%
172D	012383073.IB	23 物产中大 SCP006	AAA	2.31%
172D	012383073.IB	23 物产中大 SCP006	AAA	2.31%
185D	012381954.IB	23 潍坊城建 SCP002	AAA	4.65%
193D	012383009.IB	23 首钢 SCP005	AAA	2.24%
207D	012382276.IB	23 杭州交投 SCP001	AAA	2.25%
238D	012382694.IB	23 张江高科 SCP001	AAA	2.20%

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
7D	102101657.IB	21 中色 MTN001	AAA	2.05%
10D	102001683.IB	20 宁舟港 MTN001	AAA	1.97%
27D	102001766.IB	20 宿迁经开 MTN001	AA	2.25%
34D+NY	102001806.IB	20 中节能 MTN004	AAA	2.22%
34D+NY	102001808.IB	20 中色 MTN002	AAA	2.10%
78D(休 2)	102002080.IB	20 汉江国资 MTN005	AAA	2.26%
94D+1.99Y	102002159.IB	20 金融街 MTN002	AAA	2.34%
111D	101801443.IB	18 京热力 MTN002	AAA	2.16%
203D	101900292.IB	19 首创集 MTN001	AAA	2.30%
207D+2Y	102100422.IB	21 奉贤交通 MTN001	AA+	2.32%
210D+2Y(休 1)	102100436.IB	21 长沙经开 MTN001	AA+	2.38%
210D+2Y(休 1)	102100436.IB	21 长沙经开 MTN001	AA+	2.38%
217D	102100501.IB	21 华润资产 MTN001	AAA	2.31%
221D	102100570.IB	21 川高速 MTN004(权益出资)	AAA	2.30%
222D	101754025.IB	17 苏州高新 MTN001	AAA/AA+	2.47%
224D+2Y(休 1)	102100576.IB	21 滁州城投 MTN001	AA+	2.42%
255D	102100912.IB	21 万科 MTN002	AAA	2.94%
255D	102100903.IB	21 上饶城投 MTN001	AA+	3.30%
277D	102100972.IB	21 贵州高速 MTN003	AAA	2.50%
282D(休 1)	132100046.IB	21 金融城建 GN002(碳中和债)	AA	2.56%
307D	102281326.IB	22 华电股 MTN003	AAA	2.26%
310D(休 1)	102281370.IB	22 华能 MTN004(转型)	AAA	2.27%
325D	102101259.IB	21 苏州国际 MTN002	AAA	2.36%
339D	102281612.IB	22 晋能煤业 MTN016A(科创票据)	AAA	2.43%
340D+2Y	101900980.IB	19 中煤能源 MTN001	AAA	2.37%
345D(休 1)	102101399.IB	21 义乌国资 MTN006	AA+	2.55%
346D	102281673.IB	22 淮安开发 MTN003	AA+	2.80%
347D+2Y	102101368.IB	21 华靖资产 MTN001	AA+	2.70%
347D+2Y	102101368.IB	21 华靖资产 MTN001	AA+	2.70%
357D+NY	102101482.IB	21 中交投 MTN001	AAA	2.56%
358D+2Y	102381992.IB	23 光明房产 MTN003	AA+	2.90%
1Y(休 1)	102101577.IB	21 恒运 MTN002	AA	2.63%
1Y	102101592.IB	21 金桥开发 MTN001	AAA	2.42%
1.03Y	102100557.IB	21 宝城投 MTN001	AA/AAA	2.90%
1.03Y	102100557.IB	21 宝城投 MTN001	AA/AAA	2.90%
1.03Y	102100557.IB	21 宝城投 MTN001	AA/AAA	2.90%
1.06Y	102101838.IB	21 鲁黄金 MTN008	AAA	2.48%
1.08Y+2Y	102101860.IB	21 越秀集团 MTN002	AAA	2.41%
1.11Y(休 2)	102101975.IB	21 南航股 MTN002	AAA	2.38%
1.17Y(休 1)	102102083.IB	21 嘉兴城投 MTN002	AAA	2.41%
1.21Y+2Y	102102237.IB	21 宁经开 MTN001	AA+	3.20%
1.48Y+NY	102380165.IB	23 中冶 MTN001	AAA	2.66%
1.48Y+NY	102380165.IB	23 中冶 MTN001	AAA	2.66%
1.5Y+NY	102000119.IB	20 陕延油 MTN001	AAA	2.75%
1.5Y+NY	102000119.IB	20 陕延油 MTN001	AAA	2.75%
1.52Y	102280348.IB	22 南安市贸 MTN001	AA	3.07%
1.55Y+1Y(休 1)	102380420.IB	23 驻马店投 MTN001	AA+	3.83%
1.57Y+NY	102380488.IB	23 中冶 MTN006	AAA	2.70%

1.57Y+NY(休 2)	102380518.IB	23 金隅 MTN001	AAA	2.77%
1.58Y+NY	102380546.IB	23 中冶 MTN007	AAA	2.71%
1.58Y+NY	102380546.IB	23 中冶 MTN007	AAA	2.71%
1.59Y(休 1)	102380663.IB	23 晋能装备 MTN003	AAA	2.71%
1.65Y+1Y(休 1)	102380851.IB	23 高淳建设 MTN002	AA	2.98%
1.69Y+NY(休 2)	102381083.IB	23 北部湾投 MTN001	AAA	3.84%
1.83Y	102281288.IB	22 柳钢集团 MTN002(科创票据)	AAA	3.77%
1.84Y(休 2)	132380045.IB	23 华能水电 GN011	AAA	2.53%
1.92Y	102381788.IB	23 山西文旅 MTN002	AA+	100
1.94Y+1Y	102381865.IB	23 白沙洲 MTN001	AA/AAA	4.40%
2.02Y+NY(休 1)	102281898.IB	22 兴城投资 MTN002A	AAA	2.99%
2.15Y(休 1)	102282218.IB	22 杭金投 MTN001	AAA	2.78%
2.17Y(休 1)	102282277.IB	22 山东港口 MTN002	AAA	2.78%
2.18Y	102282336.IB	22 南电 MTN004	AAA	2.48%
2.6Y	102380677.IB	23 北控 MTN001	AAA	2.75%
2.87Y+NY	102381577.IB	23 中电投 MTN022B	AAA	2.96%
2.87Y+NY	102381577.IB	23 中电投 MTN022B	AAA	2.96%
2.88Y	102101249.IB	21 金圆投资 MTN002	AAA	2.84%
2.92Y+NY	102381769.IB	23 华润 MTN002	AAA	2.87%
2.96Y	102381939.IB	23 济南高新 MTN003	AAA	3.42%
2.99Y(休 2)	102382084.IB	23 河钢集 MTN011	AAA	100
3.27Y	102103081.IB	21 淄博城资 MTN002	AA+/AAA	4.75%
3.84Y	102281354.IB	22 义乌国资 MTN003	AA+	3.20%
3.9Y	102281535.IB	22 华发集团 MTN010(科创票据)	AAA	3.79%
4.87Y	102381575.IB	23 蜀道投资 MTN005	AAA	3.17%

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
26D+5Y	1828008.IB	18 中信银行二级 01	AAA	2.12%
54D+5Y	1828011.IB	18 中国银行二级 02	AAA	2.15%
164D+NY	1928001.IB	19 中国银行永续债 01	AAA	2.30%
164D+NY	1928001.IB	19 中国银行永续债 01	AAA	2.30%
220D+5Y(休 1)	1928006.IB	19 工商银行二级 01	AAA	2.34%
242D	2120030.IB	21 华润银行小微债	AAA	2.18%
303D(休 1)	2120049.IB	21 齐鲁银行小微债 01	AAA	2.27%
1.01Y+5Y	1920049.IB	19 成都银行二级	AAA	2.48%
1.09Y+5Y	1928026.IB	19 兴业银行二级 02	AAA	2.41%
1.09Y+NY	1928025.IB	19 交通银行永续债	AAA	2.49%
1.16Y	1920062.IB	19 宁波银行小微债 03	AAA	2.305%
1.23Y(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.29%
1.24Y+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	2.46%
1.24Y+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	2.46%
1.3Y	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	2.30%
1.44Y(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	2.34%
1.44Y(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	2.34%
1.56Y	2220022.IB	22 贵州银行绿色债	AAA	2.56%
1.56Y	2220022.IB	22 贵州银行绿色债	AAA	2.56%
1.57Y	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	2.36%
1.58Y	2220024.IB	22 江苏银行小微债	AAA	2.38%
1.76Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.53%
1.76Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.53%
1.86Y+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	3.44%
1.96Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.615%
2.1Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.775%
2.17Y	2228050.IB	22 光大银行	AAA	2.4775%
2.21Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.685%
2.21Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.685%
2.21Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.69%
2.22Y	2220074.IB	22 宁波银行 04	AAA	2.525%
2.24Y	2220078.IB	22 杭州银行债 02	AAA	2.52%
2.27Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.825%
2.27Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.825%
2.27Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.83%
2.59Y+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	2.87%
2.59Y+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	2.87%
2.59Y+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	2.87%
2.59Y+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	2.87%
2.69Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.925%
2.69Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.925%
2.75Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	2.90%

2.75Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	2.90%
2.75Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	2.91%
2.81Y	2328018.IB	23 兴业银行绿色金融债 02	AAA	2.57%
2.92Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.56%
2.92Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.56%
2.94Y(休 1)	212380013.IB	23 浙商银行债 01	AAA	100
2.94Y(休 1)	2320035.IB	23 齐鲁银行小微债 01	AAA	2.66%
2.94Y(休 1)	2320035.IB	23 齐鲁银行小微债 01	AAA	2.66%
2.94Y(休 1)	212380013.IB	23 浙商银行债 01	AAA	100
2.94Y(休 1)	2320035.IB	23 齐鲁银行小微债 01	AAA	2.66%
2.94Y(休 1)	2320035.IB	23 齐鲁银行小微债 01	AAA	2.66%
2.94Y(休 1)	212380013.IB	23 浙商银行债 01	AAA	100
2.94Y(休 1)	212380013.IB	23 浙商银行债 01	AAA	100
2.94Y(休 1)	212380013.IB	23 浙商银行债 01	AAA	100
2.94Y(休 1)	212380013.IB	23 浙商银行债 01	AAA	100
2.94Y(休 1)	212380013.IB	23 浙商银行债 01	AAA	100
2.94Y(休 1)	2320030.IB	23 三峡银行三农债	AA+	2.775%
2.94Y	2328020.IB	23 渤海银行 02	AAA	2.71%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.605%
2.94Y	2320034.IB	23 北京银行 02	AAA	2.605%
2.94Y	2320034.IB	23 北京银行 02	AAA	2.605%
2.94Y	2320034.IB	23 北京银行 02	AAA	2.61%
2.94Y	2320034.IB	23 北京银行 02	AAA	2.61%
2.95Y(休 2)	212380010.IB	23 华夏银行债 03	AAA	2.58%
2.95Y(休 2)	212380010.IB	23 华夏银行债 03	AAA	2.58%
2.95Y(休 2)	212380010.IB	23 华夏银行债 03	AAA	2.58%
2.95Y(休 2)	212380010.IB	23 华夏银行债 03	AAA	2.58%
2.95Y(休 2)	212380010.IB	23 华夏银行债 03	AAA	2.58%
2.95Y(休 2)	212380010.IB	23 华夏银行债 03	AAA	2.58%
2.98Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.8225%
2.98Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.82%
3.27Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA	2.995%
3.33Y+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	2.895%
3.42Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	2.92%
3.52Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	3.04%
3.55Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.94%
3.65Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	3.07%
3.65Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	3.07%
3.83Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.98%
3.84Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	2.98%
4.22Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	3.02%
4.59Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	3.03%
4.65Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA	3.03%
4.65Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA	3.03%
4.92Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	3.20%
4.92Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	3.20%
4.92Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	3.20%
63D+NY	175247.SH	20 邮政 Y2	AAA	2.11%
66D+NY	149275.SZ	20 攀钢 Y1	AAA	2.59%
66D+1.99Y	2080313.IB	20 宜宾国资 04	AAA	2.05%
79D(休 1)	2022040.IB	20 建信租赁债 01	AAA	1.95%
79D(休 1)	2022040.IB	20 建信租赁债 01	AAA	1.95%
83D	2022043.IB	20 交银租赁债 01	AAA	1.95%
84D+4Y	177075.SH	20 商发 01	AA+	3.2

198D(休 1)	175791.SH	GC 京投 01	AAA	2.23%
198D(休 1)	175791.SH	GC 京投 01	AAA	2.23%
199D	155201.SH	19 陆债 01	AAA	2.38%
203D+NY	2180066.IB	21 武铁绿色永续期债 01	AAA	2.45%
210D+2Y(休 1)	175845.SH	21SIIC01	AAA	2.35%
213D+2Y	149412.SZ	21 广电 01	AAA	2.28%
246D(休 2)	115256.SH	23 津投 08	AAA	4.40%
247D+2Y	115269.SH	23 山钢 03	AAA	2.45%
250D+2Y	250735.SH	23 动投 01	AA/AA+	3.90%
252D	188026.SH	21 华租 01	AAA	2.38%
254D(休 1)	188079.SH	21 凤凰 02	AAA	2.33%
254D(休 1)	188079.SH	21 凤凰 02	AAA	2.33%
255D+3Y	185641.SH	22 华发 01	AAA	3.02%
292D+2Y	251204.SH	23 武开 04	AA+/AAA	4.00%
329D	188387.SH	21 招证 G5	AAA	2.27%
329D	188387.SH	21 招证 G5	AAA	2.27%
336D	196649.SH	21 国证 F2	AAA	2.30%
337D(休 2)	1780153.IB	17 常德鼎力债	AA	4.07%
338D+NY(休 1)	115620.SH	凯盛 YK03	AAA	2.84%
343D+2Y(休 1)	149567.SZ	21 万科 05	AAA	3.08%
344D+1Y(休 1)	115710.SH	23 远东五	AAA	4.27%
345D+1Y	182343.SH	22 河钢 K1	AAA	2.57%
345D+2Y	188476.SH	21 首开 02	AAA	2.53%
350D	151854.SH	19 株城 04	AA+	3.14%
351D(休 2)	182381.SH	22 恒业 01	AA+	6.20%
357D	188508.SH	21 安信 C1	AAA	2.30%
357D	188508.SH	21 安信 C1	AAA	2.30%
357D	149589.SZ	21 深担 01	AAA	2.43%
1Y+2Y	196892.SH	21 绍交 01	AAA	2.46%
1Y+2Y	196892.SH	21 绍交 01	AAA	2.46%
1.01Y	151988.SH	19 先导 01	AAA	2.56%
1.21Y+2Y	133110.SZ	21 吉安 01	AA	3.04%
1.23Y(休 1)	188980.SH	21 兴业 06	AAA	2.37%
1.26Y	138597.SH	22 华泰 G6	AAA	2.37%
1.31Y+NY	149739.SZ	21 天健 Y1	AA+/AAA	2.85%
1.38Y+2Y	2180534.IB	21 应城小微债 01	AA/AAA	3.10%
1.42Y	149781.SZ	22 长江 01	AAA	2.50%
1.42Y+1Y(休 2)	114714.SH	23 信投 F1	AAA	2.64%
1.53Y	112079.SH	22 远航 62	AAA	3.65%
1.57Y	115020.SH	23 中证 G4	AAA	2.43%
1.57Y	115020.SH	23 中证 G4	AAA	2.43%
1.57Y	115020.SH	23 中证 G4	AAA	2.43%
1.59Y+2Y	185330.SH	22 株国 01	AA+	4.13%
1.61Y	250473.SH	23 建发 01	AA+	3.32%
1.62Y+5Y	2023005.IB	20 平安人寿	AAA	2.70%
1.67Y(休 1)	185685.SH	22 中科 01	AA+	3.10%
1.69Y+4Y	2280193.IB	22 徐新债	AA/AA+	2.95%
1.69Y+4Y	2280193.IB	22 徐新债	AA/AA+	2.95%
1.72Y	194511.SH	22 天风 03	AAA	3.60%
1.96Y	148009.SZ	22 广发 04	AAA	100
1.96Y	148009.SZ	22 广发 04	AAA	100
1.96Y	148009.SZ	22 广发 04	AAA	100
2.23Y	177088.SH	20 南水 01	AA+/AAA	2.96%
2.46Y	138868.SH	23 陆集 01	AAA	2.75%
2.67Y	175980.SH	甬交投 04	AAA	2.73%
2.68Y+2Y	115319.SH	23 吉高 01	AAA	3.50%
2.68Y+2Y	115319.SH	23 吉高 01	AAA	3.50%
2.68Y+2Y	115319.SH	23 吉高 01	AAA	3.50%
2.83Y	149519.SZ	21 广新 04	AAA	2.90%
2.91Y	2180278.IB	21 皖交债 01	AAA	2.64%
2.92Y(休 1)	115675.SH	23 国科 01	AAA	2.77%
2.94Y+2Y	115726.SH	23 穗投 02	AAA	2.87%
2.99Y	115781.SH	23 中证 16	AAA	2.66%
3.25Y+2Y	184119.SH	21 丽城 01	AA+	2.98%
3.39Y	2080001.IB	20 镜湖债	AA/AA+	3.30%
3.5Y	2280056.IB	22 铁道 01	AAA	2.56%
3.5Y	2280056.IB	22 铁道 01	AAA	2.56%
3.65Y+2Y	2280154.IB	22 钱城债 01	AA+/AAA	3.05%
4.76Y+5Y	092303003.IB	23 进出口行二级资本债 01	--/--	3.045%
4.76Y+5Y	092303003.IB	23 进出口行二级资本债 01	--/--	3.05%
4.76Y+5Y	092303003.IB	23 进出口行二级资本债 01	--/--	3.05%
4.76Y+5Y	092303003.IB	23 进出口行二级资本债 01	--/--	3.05%

4.76Y+5Y	092303003.IB	23 进出口行二级资本债 01	--/--	3.05%
155D+2Y	032100077.IB	21 襄阳住房 PPN001	AA+	2.62%
171D+2Y	032100204.IB	21 常城建 PPN002	AAA	2.30%
245D+1Y(休 2)	032380374.IB	23 青岛黄岛 PPN001	AA+	3.20%
312D	032100697.IB	21 泰兴城投 PPN001	AA+	2.90%
1.01Y	031900648.IB	19 沧州建投 PPN002	AA+	2.66%
1.02Y	032100910.IB	21 京城投 PPN002	AAA	2.65%
1.1Y	031900714.IB	19 荆门城投 PPN002	AA	3.30%
1.1Y	031900714.IB	19 荆门城投 PPN002	AA	3.30%
1.18Y	032101143.IB	21 柯桥国资 PPN003	AA+	2.68%
1.23Y+1Y	032281029.IB	22 日照集团 PPN001	AA+	3.95%
1.35Y+2Y	032191493.IB	21 洛阳盛世 PPN001	AA/AAA	5.17%
1.42Y	032280121.IB	22 惠安交发 PPN001	AA	3.32%
1.53Y	032380171.IB	23 镇江城建 PPN001	AA+	3.10%
1.57Y+2Y(休 1)	032280281.IB	22 乌城投 PPN001	AAA	2.68%
1.68Y+2Y(休 1)	032200174.IB	22 济西城投 PPN001	AAA	2.72%
1.81Y+2Y	032280524.IB	22 烟台财金 PPN001	AA	3.44%
1.92Y+1Y(休 1)	032380662.IB	23 襄阳高新 PPN002	AA	3.58%
26D+5Y	1828008.IB	18 中信银行二级 01	AAA	2.12%
54D+5Y	1828011.IB	18 中国银行二级 02	AAA	2.15%
164D+NY	1928001.IB	19 中国银行永续债 01	AAA	2.30%
164D+NY	1928001.IB	19 中国银行永续债 01	AAA	2.30%
220D+5Y(休 1)	1928006.IB	19 工商银行二级 01	AAA	2.34%
242D	2120030.IB	21 华润银行小微债	AAA	2.18%
303D(休 1)	2120049.IB	21 齐鲁银行小微债 01	AAA	2.27%