



【2024-10-16】

国债

央行公告称，为对冲中期借贷便利（MLF）和公开市场逆回购到期等因素的影响，维护银行体系流动性合理充裕，10月16日以固定利率、数量招标方式开展了6424亿元7天期逆回购操作，操作利率1.50%。Wind数据显示，当日610亿元逆回购和7890亿元MLF到期。

国债方面 282D 240015 1.44-1.445； 2.83Y 240016 1.6275-1.635； 4.75Y 240014 1.78-1.80； 6.69Y 240013 1.98-2.00； 9.61Y 240011 2.11-2.125； 29Y 230023 2.2725-2.30。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.4425	1.6100	1.7825	1.9900	2.1100	2.2875
今日国债(%)	1.4425	1.6200	1.8000	1.9975	2.1225	2.3050
变动(%)	0.0000	0.0100	0.0175	0.0075	0.0125	0.0175

金融债

金融债方面 282D 240421 1.68-1.705； 4.35Y 240203 1.85-1.875； 6.01Y 200215 2.035-2.045； 9.72Y 240420 2.215-2.23。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.6800	1.8000	1.9000	2.1700	2.2200
今日非国开金融债(%)	1.6700	1.8025	1.9100	2.1700	2.2275
变动(%)	-0.0100	0.0025	0.0100	0.0000	0.0075
昨日国开债(%)	1.6850	1.7750	1.8475	2.0800	2.1950
今日国开债(%)	1.6800	1.7950	1.8750	2.0900	2.2060
变动(%)	-0.0050	0.0200	0.0275	0.0100	0.0110

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Q2期限。短端方面，58D 012480923.IB 24 深圳港集 SCP001 AAA 在2.00%成交（估值-5位置），券商出给基金；65D 012481251.IB 24 鲁招金 SCP003(科创票据) AAA 在1.95%成交（估值-11位置），基金出给基金。中长端方面，149D 012481866.IB 24 粤环保 SCP003 AAA 在2.07%成交（估值-1位置），资管出给基金；167D 012482050.IB 24 冀建交通 SCP001 AAA 在2.08%成交（估值-1位置），基金出给基金。长端方面，209D 012482463.IB 24 南昌交投 SCP004 AAA 在2.14%成交（估值-5位置），银行出给基金；265D 012483247.IB 24 广州控股 SCP008 AAA 在2.10%成交，估值-3位置，银行出给基金。总体而言，短端、中长端和长端收益均轻微震荡，变动不大。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	1.94		1.99		2.02		2		2.02	
	AA+	1.96		2.1		2.11		2.09		2.2	
	AA	2.05		2.08		2.15		2.13		2.16	
	AA-	2.1		2.3		2.2		2.22		2.34	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	1.96	-2	2	-1	2.01	1	2.02	-2	2.07	-5
	AA+	2.05	-9	2.13	-3	2.14	-3	2.09	0	2.15	5
	AA	2.08	-3	2.13	-5	2.15	0	2.15	-2	2.16	0
	AA-	2.17	-7	2.19	11	2.19	1	2.24	-2	2.4	-6

中期票据

今日中票交投情绪平淡，1-3 年短端中票，21 越秀交通 MTN001（AAA，1.28Y）在 2.10%高估值 1bp 的位置成交；23 重庆地产 MTN001A（AAA，1.77Y）在 2.40%低估值 3bp 位置成交；24 华阳新材 MTN007（AAA，2.53Y）在 2.60%低估值 2bp 位置成交；3 到 5 年期限，23 陕延油 MTN006B（AAA，4.18Y）在 2.45%低估值 5bp 位置成交；24 新矿集团 MTN001B（AAA，4.39Y）成交在 2.60%，低估值 6bp 的位置；24 铁道 MTN001（AAA，4.39Y）成交在 2.14%，低估 1bp 位置。5Y 及以上期限，24 京国资 MTN003A（AAA，9.43Y）在 2.50%低估值 2bp 的位置成交；24 中粮 MTN001（AAA，9.68Y）成交在 2.48%，低估值 1bp 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+	2.02		2.14		2.26		2.46		None	
	AAA	2.16		2.25		2.45		None		None	
	AA+	2.31		2.42		2.63		None		None	
	AA	2.43		2.56		2.98		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.02	0	2.13	1	2.25	1	2.45	1	None	None
	AAA	2.17	-1	2.24	1	2.43	2	None	None	None	None
	AA+	2.33	-2	2.42	0	2.62	1	None	None	None	None
	AA	2.45	-2	2.56	0	2.97	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，21 金隅 01 AAA 成交在 2.37%，理财卖出，基金买入。 22 深机 01 AAA 成交在 2.06%，基金卖出，理财买入。22 朝国 01 AAA 成交在 2.07%，基金卖出，基金买入。城投方面，24 津投 09 AAA 成交在 2.95%，券商卖出，理财买入。19 津投 08 AAA 成交在 3.00%，券商卖出，保险买入。24 津投 15 AA+ 成交在 2.95%，基金卖出，理财买入。长端方面，24 穗建 02AAA 成交在 2.86%。23 深铁 05 AAA 成交在 2.50%。24 榕水 04 AAA 成交在 2.63%。

银行债

今日银行债成交尚可，市场先下后上。5Y 大行二级早盘成交在估值+1，随后小幅下行至估值-0.75，下午情绪转若，卖盘力量增强，成交达到估值+2 位置，收盘在估值+3.5 附近，基金、券商、保险和理财参与双边。24 农行二级资本债 01A（4.31Y）早盘成交在 2.28%（+0.5），随后在 2.29%（+1.5）成交多笔，收盘成交在 2.30%（+2.5），保险和基金出给理财、券商和基金。3Y 附近，早盘成交在估值-1 附近，随后有所上行至估值+2，成交保持在估值+2 直至收盘，基金和券商出给基金、银行和理财。短端换手较为活跃，成交在估值-0.5 到估值+1，基金、理财、券商、银行参与双边。21 招商银行永续债（2.14Y）在 2.20%-2.21%（+1）成交，券商、基金和理财出给券商和基金。商金方面，成交多在估值-1 到估值+1 之间，基金、银行和理财出给基金。22 光大银行（1.01Y）在 1.97%（-0.5）成交多笔，基金和理财出给基金。

美元债

今天投资级市场整体交投清淡，利差较昨日基本持平。二级交易集中在新发，中信证券浮息、股息债围绕 reoffer 附近；江苏科维（江苏银行 SBLC）有小量买盘需求在 par。金融板块，券商、金租浮息债有双向交投，在+72~74 附近。城投板块，烟台国丰持续有买盘需求，价格上涨 0.1pt。地产板块，万科、龙湖、新城等在股价影响下，上涨 0.5-1pt。违约重组名字也有小幅上涨。

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	012482282.IB	24 电建新能 SCP001	AAA	1.95%
9D	012480412.IB	24 鲁招金 SCP002	AAA	2.00%
14D	042380616.IB	23 渝兴永 CP001	AA/A-1	2.54%
19D	012480527.IB	24 津渤海 SCP003	AAA	2.43%
39D(休 1)	012481122.IB	24 未来科技 SCP001	AA	100
49D	042380724.IB	23 岳阳建投 CP001	AA+	2.08%
57D	012481289.IB	24 未来科技 SCP002	AA	100
58D	012480923.IB	24 深圳港集 SCP001	AAA	2.00%
58D	012480923.IB	24 深圳港集 SCP001	AAA	2.00%
60D(休 1)	042380748.IB	23 云投 CP004	AAA	2.40%
62D	012482389.IB	24 华为 SCP004	AAA	1.95%
65D	012481251.IB	24 鲁招金 SCP003(科创票据)	AAA	1.95%
65D	012481251.IB	24 鲁招金 SCP003(科创票据)	AAA	1.95%
71D	012482595.IB	24 中交上航 SCP004(科创票据)	AAA	2.07%
93D	012481371.IB	24 陕延油 SCP004	AAA	2.02%
96D	012481451.IB	24 金汇五金 SCP001	AA	2.30%
100D	012483003.IB	24 华侨城 SCP003	AAA	2.62%
100D	012483003.IB	24 华侨城 SCP003	AAA	2.62%
107D(休 4)	042480062.IB	24 丹投 CP001	AA+	2.45%
125D	012482519.IB	24 申能股 SCP004	AAA	2.01%
125D	012482519.IB	24 申能股 SCP004	AAA	2.01%
128D	072410131.IB	24 平安证券 CP010	AAA	1.97%
128D	072410131.IB	24 平安证券 CP010	AAA	1.97%
149D	012481866.IB	24 粤环保 SCP003	AAA	2.07%

149D	012481866.IB	24 粤环保 SCP003	AAA	2.07%
166D	012482044.IB	24 国盛 SCP005	AAA	2.00%
167D	012482050.IB	24 冀建交通 SCP001	AAA	2.08%
174D	012482121.IB	24 中铝集 SCP003(科创票据)	AAA	2.03%
180D	012482192.IB	24 青岛西海 SCP001	AAA	2.20%
182D	072410100.IB	24 中信建投 CP001	AAA	1.96%
184D	012483131.IB	24 苏城投 SCP004	AAA	2.00%
191D	012482517.IB	24 中核租赁 SCP002(绿色)	AAA	2.07%
191D	012482517.IB	24 中核租赁 SCP002(绿色)	AAA	2.07%
202D	012482401.IB	24 伊犁财通 SCP004	AA+	2.35%
209D	012482463.IB	24 南昌交投 SCP004	AAA	2.14%
209D	012482463.IB	24 南昌交投 SCP004	AAA	2.14%
209D	012482463.IB	24 南昌交投 SCP004	AAA	2.14%
212D	012482499.IB	24 沪电力 SCP017	AAA	2.00%
214D(休 1)	042480368.IB	24 电网 CP010	AAA	2.00%
214D(休 1)	042480368.IB	24 电网 CP010	AAA	2.00%
214D(休 1)	042480368.IB	24 电网 CP010	AAA	2.00%
230D	012483120.IB	24 杭金投 SCP006	AAA	2.10%
247D	012483184.IB	24 立讯精工 SCP007	AAA	2.28%
262D(休 2)	042400072.IB	24 辽成大 CP002	AA+	2.62%
265D	012483247.IB	24 广州控股 SCP008	AAA	2.10%
265D	012483247.IB	24 广州控股 SCP008	AAA	2.10%
288D	042480389.IB	24 咸阳城发 CP001	AA+	2.46%
288D	042480389.IB	24 咸阳城发 CP001	AA+	2.46%
288D	042480389.IB	24 咸阳城发 CP001	AA+	2.45%
314D	042480429.IB	24 临沂城投 CP004	AAA	2.21%

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
6D	102102056.IB	21 鲁高速 MTN007	AAA	2.00%
9D	102102119.IB	21 申迪 MTN002	AAA	2.00%
9D	102102119.IB	21 申迪 MTN002	AAA	2.00%
9D	102102119.IB	21 申迪 MTN002	AAA	2.00%
33D	102103007.IB	21 淮安城资 MTN003	AA+	2.18%
38D(休 2)	102103063.IB	21 鲁能源 MTN007	AAA	2.20%
39D(休 1)	102103078.IB	21 城建设计 MTN001	AA+	2.20%
41D+2Y	102103111.IB	21 重庆临空 MTN002	AA+	2.55%
41D+NY	102103103.IB	21 蜀道投资 MTN006	AAA	2.13%
44D+2Y(休 1)	102103131.IB	21 衡阳城投 MTN003	AA+	2.03%
48D+2Y	102103166.IB	21 诚通控股 MTN007	AAA	1.98%
48D+2Y	102103166.IB	21 诚通控股 MTN007	AAA	1.98%
55D	102103234.IB	21 苏国信 MTN015	AAA	1.93%
59D(休 2)	102103247.IB	21 栖霞建设 MTN003	AA/AA+	2.50%
62D	102103278.IB	21 三一 MTN002	AAA	2.20%
69D	102103330.IB	21 柯桥国资 MTN002	AA+	2.11%
69D	102103330.IB	21 柯桥国资 MTN002	AA+	2.11%
90D	102280101.IB	22 河钢集 MTN001	AAA	2.20%
90D	102280090.IB	22 中海企业 MTN001A	AAA	2.19%
95D+2Y	102280136.IB	22 北部湾投 MTN001	AAA	2.23%
125D	102280281.IB	22 深航空 MTN001	AA+	2.16%
129D+1Y(休 1)	102380256.IB	23 国惠投资 MTN001A	AAA	2.30%
138D	102200108.IB	22 中交房产 MTN001	AAA	2.30%
138D	102200108.IB	22 中交房产 MTN001	AAA	2.30%
141D	102000242.IB	20 皖出版 MTN001	AA+	2.30%
144D+2Y	102280459.IB	22 城投公路 MTN001	AAA	2.10%
144D(休 1)	102000269.IB	20 克拉玛依 MTN001	AA+	2.40%
169D+NY	102380765.IB	23 苏科技城 MTN002(绿色)	AA	2.29%
179D(休 1)	102280759.IB	22 晋能煤业 MTN006	AAA	2.18%
186D(休 1)	102280831.IB	22 华电股 MTN002A	AAA	2.00%
191D+1Y(休 2)	102381063.IB	23 孝感高创 MTN002	AA	2.34%
193D(休 1)	102280974.IB	22 陕延油 MTN001	AAA	2.03%
220D(休 2)	102383176.IB	23 云投 MTN003	AAA	2.47%
223D	102281131.IB	22 嘉公路 MTN001A	AA+	2.23%
234D+3Y	102381321.IB	23 河南资源 MTN002	AA+	2.40%
243D+3Y	102381440.IB	23 大足发展 MTN002	AA+	2.45%
251D	102281394.IB	22 邳州润城 MTN001	AA/AA+	2.47%
265D	102281493.IB	22 苏交通 MTN003	AAA	2.00%
288D	102001442.IB	20 武侯产业 MTN002	AA+	2.20%
293D+NY	102281715.IB	22 苏州高新 MTN003(科创票 据)	AAA	2.17%
306D	102281833.IB	22 娄底高新 MTN002	AA+	2.22%

309D+NY	102300441.IB	23 华能 MTN013	AAA	2.08%
328D+NY	102282064.IB	22 陕延油 MTN003	AAA	2.10%
334D	102382479.IB	23 芜湖新马 MTN001	AA	2.35%
336D	132000029.IB	20 沈阳地铁 GN002	AAA	2.36%
341D	102282133.IB	22 中电投 MTN028	AAA	2.00%
342D	102282150.IB	22 国航 MTN001	AAA	2.02%
361D+NY(休 1)	102282222.IB	22 大唐发电 MTN009	AAA	2.10%
363D+2Y	102282242.IB	22 衡阳城投 MTN004	AA+	2.25%
363D+2Y	102282242.IB	22 衡阳城投 MTN004	AA+	2.25%
1.02Y	102282339.IB	22 九江置地 MTN001	AA/AAA	2.27%
1.02Y+NY	102282334.IB	22 华能 MTN010	AAA	2.10%
1.02Y(休 2)	102382849.IB	23 悦达 MTN002	AAA	2.40%
1.02Y(休 2)	102382849.IB	23 悦达 MTN002	AAA	2.40%
1.02Y(休 2)	102382849.IB	23 悦达 MTN002	AAA	2.40%
1.08Y	102383036.IB	23 城发投资 MTN003	AA+	2.41%
1.24Y(休 2)	102480067.IB	24 水发集团 MTN001A	AAA	2.70%
1.28Y	102100198.IB	21 越秀交通 MTN001	AAA	2.10%
1.36Y	102380285.IB	23 武进经发 MTN003	AA+	2.27%
1.41Y+NY	102380475.IB	23 供销 MTN001	AAA	2.38%
1.45Y+NY	102380757.IB	23 温州名城 MTN002	AA+/AAA	2.32%
1.53Y	102481759.IB	24 云建投 MTN009	AAA	2.80%
1.56Y+2Y	102381157.IB	23 株洲城建 MTN003	AA+	2.42%
1.75Y	102482015.IB	24 云建投 MTN010	AAA	2.88%
1.77Y+2Y	102381801.IB	23 重庆地产 MTN001A	AAA	2.40%
1.81Y+2Y	102381973.IB	23 川投资 MTN001	AAA	2.23%
1.89Y(休 1)	102382402.IB	23 淮安国投 MTN004	AAA	2.33%
1.94Y+NY	102484203.IB	24 桂交投 MTN018A	AAA	2.38%
2.02Y+2Y	102382855.IB	23 常德经建 MTN004	AA+	2.55%
2.53Y	102481797.IB	24 湖南城铁 MTN001	AA+	2.36%
2.53Y	102481797.IB	24 湖南城铁 MTN001	AA+	2.36%
2.53Y	102481797.IB	24 湖南城铁 MTN001	AA+	2.36%
2.53Y	102481796.IB	24 华阳新材 MTN007	AAA	2.60%
2.53Y	102481796.IB	24 华阳新材 MTN007	AAA	2.60%
2.53Y	102481796.IB	24 华阳新材 MTN007	AAA	2.60%
2.53Y	102481787.IB	24 南京地铁 MTN004	AAA	2.14%
2.53Y	102481787.IB	24 南京地铁 MTN004	AAA	2.14%
2.6Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	2.15%
2.6Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	2.15%
2.62Y	102482122.IB	24 景德镇陶 MTN003	AA+	2.80%
2.64Y	102482183.IB	24 巴斯夫 MTN001BC	AAA	2.37%
2.74Y+2Y	102482982.IB	24 联合光伏 MTN001A	AA+	2.62%
2.85Y+2Y	102483670.IB	24 华发集团 MTN014	AAA	2.90%
2.85Y	102281887.IB	22 岳阳建投 MTN001	AA+	2.36%
2.86Y	102483819.IB	24 国家能源 MTN001	AAA	2.14%
2.91Y	102484099.IB	24 水发集团 MTN009	AAA	3.05%
2.95Y	102484301.IB	24 江西交投 MTN011	AAA	2.17%
4.18Y+NY	102383406.IB	23 陕延油 MTN006B	AAA	2.45%
4.31Y+NY	102480464.IB	24 陕延油 MTN005	AAA	2.50%
4.39Y	102480678.IB	24 新矿集团 MTN001B(科创 票据)	AAA	2.60%
4.39Y	102480678.IB	24 新矿集团 MTN001B(科创 票据)	AAA	2.60%
4.39Y	102480678.IB	24 新矿集团 MTN001B(科创 票据)	AAA	2.60%
4.39Y	102480678.IB	24 新矿集团 MTN001B(科创 票据)	AAA	2.60%
4.39Y	102480808.IB	24 铁道 MTN001	AAA	2.14%
4.45Y	102481221.IB	24 海运集装 MTN002(科创票 据)	AAA	2.41%
4.45Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	2.27%
4.46Y	102481313.IB	24 郑州城发 MTN001	AAA	2.48%
4.52Y(休 1)	102481675.IB	24 武清国资 MTN002B	AA+	3.61%
4.68Y	102482698.IB	24 东方新城 MTN004	AA+	2.68%
4.78Y	102483211.IB	24 陕投集团 MTN004	AAA	2.44%
4.83Y	102483583.IB	24 晋江城投 MTN001	AA+	2.49%
4.91Y	102484072.IB	24 常德城投 MTN002	AA+	2.51%
4.94Y(休 1)	102484217.IB	24 汇金 MTN007	AAA	2.25%
4.94Y+NY(休 1)	102484190.IB	24 锡产业 MTN007	AAA	2.66%
9.43Y	102481082.IB	24 京国资 MTN003A	AAA	2.50%
9.52Y	102481719.IB	24 南电 MTN006	AAA	2.47%
9.68Y	102482400.IB	24 中粮 MTN001	AAA	2.48%
9.79Y	102483332.IB	24 首旅 MTN012	AAA	2.90%
9.79Y	102483332.IB	24 首旅 MTN012	AAA	2.90%

9.81Y	102483405.IB	24 中建材集 MTN001B(科创 票据)	AAA	2.60%
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
9D	162119.SH	19 北碚 01	AA	2.60%
9D	151530.SH	19 开乾 01	AA	2.70%
34D	162537.SH	19 四面山	AA	2.90%
37D+2Y(休 1)	185041.SH	21 金隅 01	AAA	2.37%
37D+2Y(休 1)	185041.SH	21 金隅 01	AAA	2.37%
37D+2Y(休 1)	185041.SH	21 金隅 01	AAA	2.37%
37D+2Y(休 1)	185041.SH	21 金隅 01	AAA	2.37%
37D+2Y(休 1)	185041.SH	21 金隅 01	AAA	2.37%
37D+2Y(休 1)	185041.SH	21 金隅 01	AAA	2.37%
37D+2Y(休 1)	185041.SH	21 金隅 01	AAA	2.37%
54D+363D(休 1)	114384.SH	22 津开 02	AA+	2.80%
64D	114462.SH	22 大足债	AA/AA+	2.60%
89D	114721.SH	23 贵溪 01	AA	2.85%
96D	185290.SH	22 开源债	AAA	2.01%
97D	149789.SZ	22 申证 01	AAA	1.94%
97D	149787.SZ	22 深机 01	AAA	2.06%
97D	149787.SZ	22 深机 01	AAA	2.06%
101D(休 2)	196269.SH	22 抚旅 01	AA/AA+	2.45%
125D+2Y	185374.SH	22 朝国 01	AAA	2.07%
140D+NY	163942.SH	20 新际 Y1	AAA	2.08%
143D+3Y	114686.SH	23 渤投 01	AA	2.60%
149D+2Y(休 1)	194034.SH	22 启东 01	AA+	2.40%
207D+NY(休 1)	115332.SH	23 中化 Y3	AAA	2.16%
228D(休 2)	163591.SH	20 常城 01	AAA	2.11%
247D	251473.SH	23 蓝创 02	AA	3.60%
249D(休 1)	194634.SH	22 德泰 01	AA+	2.85%
262D+1Y(休 1)	251626.SH	23 上饶 02	AA+	2.54%
267D	115591.SH	23 信投 C3	AAA	1.99%
267D	115591.SH	23 信投 C3	AAA	1.99%
275D+NY	137533.SH	22 铁建 Y3	AAA	2.10%
277D(休 1)	194934.SH	22 中泰 F1	AAA	2.02%
283D(休 2)	137555.SH	22 海通 04	AAA	2.03%
285D	182321.SH	22 咸金 04	AA/AAA	2.60%
295D	115758.SH	23 青信 05	AAA	2.20%
295D	251863.SH	23 浙商 F1	AAA	2.05%
305D+1Y	184531.SH	22 日月 01	AA/AA+	2.70%
305D+1Y	184531.SH	22 日月 01	AA/AA+	2.70%
317D	182499.SH	22 大兴 02	AAA	2.17%
326D(休 1)	137771.SH	22 国元 G1	AAA	2.16%
345D+2Y(休 1)	182856.SH	22 沧港 02	AA	2.45%
345D+1Y(休 2)	240030.SH	23 穗港 03	AAA	2.06%
1Y	252663.SH	23 兴业 F3	AAA	2.03%
1.01Y	252792.SH	23 延新 01	AA+	2.50%
1.01Y	148090.SZ	22 天投 01	AAA	2.12%
1.02Y	182923.SH	22 通经 06	AA+	2.21%
1.03Y+2Y	182960.SH	22 高创 02	AA+	3.02%
1.03Y+2Y	182960.SH	22 高创 02	AA+	3.02%
1.03Y+3Y	175302.SH	20 青城 04	AAA	2.16%
1.1Y+NY(休 2)	138638.SH	22 延长 Y1	AAA	2.12%
1.1Y+NY(休 2)	138638.SH	22 延长 Y1	AAA	2.12%
1.1Y+2Y	138619.SH	22 首科 K1	AA/AAA	2.20%
1.14Y+2Y	133361.SZ	22 发控 01	AAA	2.33%
1.14Y+2Y	133361.SZ	22 发控 01	AAA	2.33%
1.14Y+2Y	133361.SZ	22 发控 01	AAA	2.33%
1.51Y(休 1)	185672.SH	22 安租 10	AAA	2.70%
1.53Y+NY(休 1)	188054.SH	21 中金 Y2	AAA	2.21%
1.58Y(休 1)	188110.SH	21 宁交 01	AAA	2.16%
1.58Y+NY(休 1)	188100.SH	21 信投 Y1	AAA	2.20%
1.58Y+NY(休 1)	188100.SH	21 信投 Y1	AAA	2.20%
1.59Y	115362.SH	23 海通 09	AAA	2.06%
1.64Y	251254.SH	23 泰兴 03	AA/AA+	2.72%
1.64Y	251287.SH	23 柯资 01	AA+	2.23%
1.87Y(休 1)	178014.SH	21 安投 01	AA/AAA	4.08%
1.87Y(休 1)	178014.SH	21 安投 01	AA/AAA	4.08%
1.87Y(休 1)	178014.SH	21 安投 01	AA/AAA	4.08%

1.94Y	139234.SH	PR 荆经开	AA	2.80%
1.98Y+NY	092100012.IB	21 长城资本债 01BC	AAA	2.74%
2.16Y	148549.SZ	23 国证 12	AAA	2.12%
2.36Y	240601.SH	24 石资 K1	AAA	2.26%
2.45Y+2Y	254354.SH	24 城发 01	AA+	2.60%
2.53Y+2Y	240980.SH	24 长轨 01	AAA	2.15%
2.77Y	148818.SZ	24 中航 K5	AAA	2.18%
2.79Y	255410.SH	24 津开 01	AA+	3.15%
4.95Y+NY	241698.SH	铁建 YK14	AAA	2.36%
4.95Y+NY	241698.SH	铁建 YK14	AAA	2.36%
6.75Y	148815.SZ	24 榕水 04	AAA	2.63%
8.69Y(休 1)	148343.SZ	23 深铁 05	AAA	2.50%
9.52Y(休 2)	240924.SH	24 中化 04	AAA	2.60%
9.52Y(休 2)	240924.SH	24 中化 04	AAA	2.60%
41D	032191333.IB	21 惠山开发 PPN001	AA	2.37%
57D	032300424.IB	23 瀚瑞投资 PPN002	AA+	2.47%
57D	032300424.IB	23 瀚瑞投资 PPN002	AA+	2.47%
66D(休 2)	032191477.IB	21 肥西城乡 PPN003	AA+	2.18%
66D(休 2)	032191477.IB	21 肥西城乡 PPN003	AA+	2.18%
89D	032280073.IB	22 淮安国联 PPN001	AAA	2.23%
145D	032280271.IB	22 青岛城投 PPN001	AAA	2.17%
183D	032000366.IB	20 武侯产业 PPN001	AA+	2.26%
249D+2Y	032280560.IB	22 溧水产投 PPN003	AA	2.45%
279D+2Y	032280655.IB	22 西海融合 PPN001	AAA	2.25%
311D+2Y	032280750.IB	22 宁波鄞通 PPN001	AA+	2.27%
319D+1Y	032380823.IB	23 大足发展 PPN002	AA+	2.85%
1.01Y+1Y	032381001.IB	23 镇江城建 PPN004	AA+	2.39%
1.09Y	032281055.IB	22 青岛城投 PPN002	AAA	2.20%
1.25Y	032100041.IB	21 衡阳城投 PPN001	AA+	2.33%
1.25Y	032100041.IB	21 衡阳城投 PPN001	AA+	2.33%
1.43Y(休 1)	032100356.IB	21 吴中经发 PPN001	AA+	2.27%
1.94Y	032101059.IB	21 台州交通 PPN004	AA+	2.30%
2.03Y	032381029.IB	23 连云港 PPN005	AA+	2.53%
2.27Y(休 2)	032480075.IB	24 泰兴城投 PPN001	AA+	2.50%
2.44Y	032400666.IB	24 宿州城投 PPN002	AA+	2.51%
2.52Y+2Y	032400714.IB	24 玄武高新 PPN001(混合型 科创票据)	AA	2.53%
2.75Y(休 1)	032400830.IB	24 海安建投 PPN002	AA+	2.55%
2.76Y+2Y(休 1)	032480722.IB	24 滨江投资 PPN002	AA+	2.50%
2.78Y	032480809.IB	24 经开国控 PPN003	AAA	2.35%
4.39Y	032400642.IB	24 常城建 PPN001	AAA	2.40%
4.83Y+NY	032400863.IB	24 汉江国资 PPN001B	AAA	2.68%
25D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	1.95%
37D+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA	2.00%
37D+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA	2.00%
56D+NY	1928036.IB	19 中信银行永续债	AAA	2.00%
56D+NY	1928036.IB	19 中信银行永续债	AAA	2.01%
71D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.13%
101D(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	1.97%
101D(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	1.97%
132D	2226002.IB	22 华商银行 01	AAA	2.04%
149D	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	1.93%
149D	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	1.93%
167D+NY	2020016.IB	20 江苏银行永续债	AAA	2.06%
167D+NY	2020016.IB	20 江苏银行永续债	AAA	2.06%
202D+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.05%
217D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.05%
217D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.05%
226D	2228034.IB	22 广发银行 02	AAA	1.96%
226D	2228033.IB	22 广发银行 01	AAA	1.96%
302D+5Y	2028024.IB	20 中信银行二级	AAA	2.06%
302D+5Y	2028024.IB	20 中信银行二级	AAA	2.06%
340D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.05%
343D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.05%
343D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.05%
343D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.05%
344D+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.08%
344D+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.08%
344D+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.08%
1.01Y	2228050.IB	22 光大银行	AAA	1.97%
1.01Y	2228050.IB	22 光大银行	AAA	1.97%
1.01Y	2228050.IB	22 光大银行	AAA	1.97%

1.01Y	2228050.IB	22 光大银行	AAA	1.97%
1.03Y	2220072.IB	22 绍兴银行小微债 02	AA+	2.14%
1.05Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.08%
1.05Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.08%
1.08Y+5Y(休 2)	2028049.IB	20 工商银行二级 02	AAA	2.05%
1.08Y+5Y(休 2)	2028049.IB	20 工商银行二级 02	AAA	2.05%
1.09Y+NY	2028048.IB	20 中国银行永续债 02	AAA	2.10%
1.45Y	212380003.IB	23 华夏银行债 01	AAA	2.01%
1.59Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	2.145%
1.75Y	2321020.IB	23 顺德农商小微债 02	AAA	2.06%
1.82Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.11%
1.85Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.13%
1.85Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.12%
1.85Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.12%
1.85Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.12%
1.85Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.12%
2.08Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	2.18%
2.08Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	2.18%
2.08Y+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	2.14%
2.11Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.17%
2.11Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.17%
2.11Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.17%
2.11Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA	2.18%
2.11Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA	2.17%
2.11Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA	2.17%
2.11Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA	2.17%
2.14Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	2.21%
2.14Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	2.21%
2.14Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	2.20%
2.14Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	2.20%
2.14Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	2.20%
2.14Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	2.20%
2.16Y+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	2.24%
2.16Y+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	2.23%
2.2Y+NY	2120118.IB	21 广州银行永续债	AAA/AA+	2.40%
2.2Y+NY	2120118.IB	21 广州银行永续债	AAA/AA+	2.40%
2.2Y+NY	2120118.IB	21 广州银行永续债	AAA/AA+	2.40%
2.26Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	2.195%
2.36Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	2.15%
2.45Y+5Y(休 1)	2220030.IB	22 重庆银行二级	AAA/AA+	2.34%
2.67Y	2420027.IB	24 东莞银行 01	AAA	2.11%
2.81Y	2420034.IB	24 厦门国际银行 01	AAA	2.17%
2.87Y+1Y	312410005.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)	AAA	2.18%
2.87Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	2.25%
2.87Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	2.25%
2.89Y+NY(休 1)	092280086.IB	22 农行永续债 02	AAA	2.245%
2.89Y+NY(休 1)	092280086.IB	22 农行永续债 02	AAA	2.245%
2.91Y(休 1)	2420041.IB	24 北部湾银行三农债	AAA	2.29%
2.95Y(休 1)	212480057.IB	24 湖南银行小微债 01	AAA	2.18%
3.14Y+5Y	232280004.IB	22 合肥科技二级资本债 01	AA+/AA	2.90%
3.2Y+5Y	232280014.IB	22 东莞农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.43%
3.43Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	2.235%
3.46Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.45%
3.46Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.44%
3.46Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.44%
3.86Y+5Y	232380033.IB	23 成都银行二级资本债 01	AAA	2.48%
3.87Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.32%
4.14Y+5Y	232380084.IB	23 中行二级资本债 04A	AAA	2.29%
4.3Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	2.31%
4.31Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.295%
4.31Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.29%
4.31Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.29%
4.31Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.29%
4.42Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.345%
4.52Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.29%
4.65Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.44%
4.65Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.44%
4.68Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.445%
4.68Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.44%
4.68Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.44%
4.68Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.40%

4.73Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.29%
4.74Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.35%
4.74Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.35%
4.74Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.35%
4.74Y+5Y	232400029.IB	24 中原银行二级资本债 01	AAA	2.80%
4.78Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.27%
4.79Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.355%
4.8Y+5Y(休 2)	232400032.IB	24 成都银行二级资本债 02	AAA	2.51%
4.8Y+5Y(休 2)	232400032.IB	24 成都银行二级资本债 02	AAA	2.51%
4.8Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.39%
4.87Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.29%
4.87Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.28%
4.94Y+5Y	232400038.IB	24 台州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.60%
4.94Y+5Y	232400038.IB	24 台州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.60%
7.07Y+5Y(休 1)	2128034.IB	21 建设银行二级 04	AAA	2.40%
7.26Y+5Y	2228005.IB	22 工商银行二级 02	AAA	2.41%
9.3Y+5Y	232480002.IB	24 中行二级资本债 01B	AAA	2.455%
9.31Y+5Y(休 1)	232480005.IB	24 农行二级资本债 01B	AAA	2.455%
9.8Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA	2.60%
9.8Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA	2.60%

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：
以上所提及附加的所有信息（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