

收盘日评 银行间债券市场

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2026-03-17】

国债

今日央行开展 510 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 395 亿，逆回购口径资金净投放 115 亿。

国债方面 1.95Y 250005 1.2975-1.30； 3.86Y 250003 1.475-1.485； 6.02Y 250007 1.6275-1.6325； 9.44Y 250016 1.83-1.8375； 29.44Y 2500006 2.297-2.306。

	1y	3y	5y	7y	10y	30y
昨日国债(%)	1.2200	1.3450	1.5600	1.6900	1.8350	2.3075
今日国债(%)	1.2150	1.3300	1.5560	1.6825	1.8350	2.3000
变动(%)	-0.0050	-0.0150	-0.0040	-0.0075	0.0000	-0.0075

金融债

金融债方面 308D 260401 1.4875-1.491； 2.94Y 240203 1.5875-1.595； 5.84Y 220205 1.758-1.769； 9.25Y 250215 1.94-1.946。

	1y	3y	5y	7y	10y
昨日非国开金融债(%)	1.4500	1.5850	1.6700	1.8450	1.9540
今日非国开金融债(%)	1.4425	1.5725	1.6600	1.8430	1.9480
变动(%)	-0.0075	-0.0125	-0.0100	-0.0020	-0.0060
昨日国开债(%)	1.4600	1.6275	1.6850	1.8325	1.9475
今日国开债(%)	1.4700	1.6200	1.6750	1.8250	1.9415
变动(%)	0.0100	-0.0075	-0.0100	-0.0075	-0.0060

银行债

1-3y 大行二级今日成交收益率较平稳，整体成交在估值到估值-0.5 附近；1y 大行今开 1.60/1.59，成交在 1.59 (-0.86)，尾盘收在 1.60/1.59。2y 大行今开 1.66/1.64，成交在 1.655 (-0.82) 和 1.65 (-1.32)，尾盘收在 1.655/1.65。今日 1-3y 大行二级交易情绪较为平淡，买卖盘力量均衡，基金、理财、券商及资管、银行均有参与。

5y 大行二级全天交易较活跃，盘中收益率低开低走，全天区间内小幅度震荡。非免税券昨收 2.11 (+0.39)，今开 2.10 (-0.61)。日内最高 2.11 (+0.39)，最低 2.10 (-0.61)，震荡区间 1bp，今收 2.1075 (+0.14)，尾盘对峙为 2.1075/2.105。盘中与同期限大行永续相差约 5bp，券商基金为主要参与方；

五年 25 工行二级资本债 02BC 昨收 2.025 (+0.10)，今开 2.0225(-0.15)，日内最高 2.0225(-0.15)，最低 2.015 (-0.90)，今收 2.015(-0.90)，尾盘对峙为 2.02/2.015，市场成交依旧火热；

十年 25 农行二级资本债 03B(BC) 昨收 2.4925 (+0.29)，今开 2.49(+0.04)，最高 2.4925(+0.29)，最低 2.49(+0.04)，今收 2.4925(+0.29)，尾盘对峙为 2.4925/2.49；

5y 股份制二永收益整体震荡。4.72y 平安永续成交在 2.27 (+1.02)，昨日收盘成在 2.27。今日股份制二永成交情绪一般，主要是基金，理财参与。

商金方面，1-3y 大行主要成在 (-1) 到 (+1)。2.53y 25 建行小微债 01BC 成在 1.685 (-1.18)。股份制主要成在 (-1.5) 到 (+1)。2.65y 25 光大银行债 03 成在 1.70 (-1.02) 到 1.71 (-0.02)。大城商行今日主要成在 (-1.5) 到估值 (+0)。科创今日主要成在 (-0.5) 到 (+1)。2.2y 25 北京银行科创债 01 成在 1.6625 (-0.35) 到 100 净价 (+0.4)。2.16y 25 浦发银行科创债 01 成在 1.6525 (-0.09)。收益率持续走低。银行、基金、保险/基金、银行为主。

短期融资券

今日银行间短融市场交投活跃度较好，成交主要集中于 2026Q2 期限。短端方面，30D 072510281.IB 25 中信建投 CP011 AAA 成交在 1.57% (+0.01)，基金出给银行；34D 012581770.IB 25 国航 SCP005 AAA 成交在 1.57% (-0.01)，基金出给银行。中长端方面，133D 042580419.IB 25 苏国信 CP003 AAA 成交在 1.58% (-0.43)，基金出给基金；174D 042580481.IB 25 国电 CP002 AAA 成交在 1.575% (-0.99)，基金出给银行。长端方面，315D 042680059 26 一汽租赁 CP001 AAA 成交在 1.65% (+0.04)，银行出给基金。总体而言，短端、中长端和长端收益日内均小幅下行。

中期票据

今日中票收益早盘在估值-1 左右，尾盘成在估值左右。汇金、电网今日成交活跃度一般，5y 汇金今日在 1.92% (+0.05) 成交。10Y 电网成在 2.27% (-0.15)。

1-3Y，好名字整体成交在估值-1 到估值+1，1.59Y 22 沪国际集 MTN001 成在 1.70% (-0.45)，2.28Y 23 蓉城轨交 MTN003 成在 1.77% (-0.31)，1.22Y 24 津城建 MTN021 成在 1.73% (-0.23)。成交收益率集中在 1.70%-1.90%，银行、券商出给银行基金。

3-5Y，好名字整体成交在估值-2 到估值+2，3.34Y 24 中节能 MTN003A 成在 1.88% (-0.93)，3.09Y 24 川高速 MTN006 成在 1.86% (+0.24)，3.01Y 24 昆山国创 MTN002 成在 1.9% (-1.73)，收益率集中在 1.90%-2.30%，银行出给银行。

5Y+，28.18Y 24 铁道 MTN003B 成在 2.515% (-0.04)；8.11Y 24 诚通控股 MTN012A 成在 2.31% (-0.53)，成交收益率主要集中在 2.00%-2.40%。永续中票集中在 3Y 的普通名字，成交收益率大概在估值-3 到估值+2，基金、券商出给券商。

企业债

交易所信用债全天交投较为活跃，基金，券商，保险，理财均有参与。全天收益小幅下行。

1 年内，券商债成交在估值到估值-2 (307D 24 招证 G1 1.55)，基金理财券商买，基金券商保险卖；非券商债多成交在 1.60-1.70，(306D 22 广铁 01 1.62)，基金理财保险买，基金券商银行卖；年内科创债今日成交寥寥 (281D 25 大唐 SK 1.62)。

1-3 年，今日券商债成交尚可，成交多在估值-1 到估值+1 (2.99Y 26 招证 G4 1.80)，基金券商保险买，基金理财银行卖；非券商债成交尚可，多成交在估值附近 (2.89Y 26 豫投 01 1.84)，基金保险券商买，基金券商银行卖。科创债成交较为活跃 (2.98Y 26 华鲁 K1 1.87)。

3-5 年，券商债成交较少；非券商债方面今日成交尚可，成交多在估值-1 到估值+1 (4.1Y 25 蓉金 G1 1.95)，基金券商资管双边参与，理财买，银行保险卖；科创方面今日成交，成交在估值-0.5 到估值+1 (4.31Y+NY 中化 KY01 2.19)，基金券商双边参与，券商资管买，银行理财卖。

5Y+，券商债成交寥寥，多成交在估值-1 附近 (9.1Y 25 国证 06 2.28)；非券商债成交较活跃，成交多在估值+1 附近 (8.25Y 24 漳九 04 2.48)，基金和券商双边参与买卖盘；科创方面亦成较活跃，多成交在估值到估值+0.5 附近 (9.6Y 25 国电 K4 2.27)，基金双边参与买卖盘。

美元债

周二市场维持供给。城投板块，获利了结卖盘持续增加，AAA 担保短期限券有少量买盘需求。地产板块整体平稳。

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 (%)
5D(休 1)	012581781.IB	25 南部新城 SCP002	AA+	2.05
10D	012581539.IB	25 南航集 SCP003	AAA	1.54
10D	012680506.IB	26 中化股 SCP001	AAA	1.58
30D	072510281.IB	25 中信建投 CP011	AAA	1.57
31D	012680099.IB	26 夏商 SCP001	AA+	1.64
31D	012680099.IB	26 夏商 SCP001	AA+	1.64
31D	012680099.IB	26 夏商 SCP001	AA+	1.64
31D	012680099.IB	26 夏商 SCP001	AA+	1.64
31D	012680099.IB	26 夏商 SCP001	AA+	1.64
31D	012680099.IB	26 夏商 SCP001	AA+	1.64
31D	012680099.IB	26 夏商 SCP001	AA+	1.64
31D	012680099.IB	26 夏商 SCP001	AA+	1.64
31D	012680099.IB	26 夏商 SCP001	AA+	1.64
31D	042580225.IB	25 高淳国资 CP001	AA+	1.65
31D	042580225.IB	25 高淳国资 CP001	AA+	1.65
34D	012581770.IB	25 国航 SCP005	AAA	1.57
44D	012583117.IB	25 中交投 SCP005	AAA	1.61
69D	012582103.IB	25 扬州交通 SCP001(绿色)	AA+	1.64
73D	042580293.IB	25 平安租赁 CP005	AAA	1.64
119D	012680118.IB	26 华能江苏 SCP001	AAA	1.6
133D	042580419.IB	25 苏国信 CP003	AAA	1.58
174D	042580481.IB	25 国电 CP002	AAA	1.575
182D	012583109.IB	25 保利久联 SCP005	AA+	3.7
182D	012583109.IB	25 保利久联 SCP005	AA+	3.7
182D	012583109.IB	25 保利久联 SCP005	AA+	3.7
205D	012680608.IB	26 东南国资 SCP002	AAA	1.61
265D	012680607.IB	26 中交天航 SCP001(科创债)	AA+	1.67
266D	012680621.IB	26 镇江产投 SCP004	AAA	1.67

295D	042680003.IB	26 泉州发展 CP001	AAA	1.64
295D	042680003.IB	26 泉州发展 CP001	AAA	1.64
295D	042680003.IB	26 泉州发展 CP001	AAA	1.64

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（%）
40D(休 1)	102481760.IB	24 远东租赁 MTN002	AAA	1.73
40D(休 1)	102481760.IB	24 远东租赁 MTN002	AAA	1.73
42D	102100889.IB	21 空港兴城 MTN001	AA+	1.65
119D	102101294.IB	21 常交通 MTN001	AA+	1.65
119D	102101294.IB	21 常交通 MTN001	AA+	1.65
126D	102381767.IB	23 赣天然气 MTN001	AA+	1.64
128D	102101365.IB	21 湛江交投 MTN001B	AA+	1.66
132D+NY(休 1)	102381825.IB	23 江北新区 MTN008	AAA	1.74 行权
143D	102381958.IB	23 邯郸城投 MTN001	AA+	1.65
154D	102382135.IB	23 溧水城建 MTN002	AA+	1.65
179D(休 2)	102382440.IB	23 新乡投资 MTN007	AAA	1.75
195D+2Y	102382647.IB	23 吉林高速 MTN004	AAA	1.68 行权
213D	102484313.IB	24 云能投 MTN022	AAA	1.67
220D	102484562.IB	24 宝城投 MTN002A	AA	1.95
224D	102382914.IB	23 汇金 MTN006A	AAA	1.59
252D	102383184.IB	23 亚盛实业 MTN001(乡村振兴)	AA	1.9
343D	132280013.IB	22 金融城建 GN001(可持续挂钩)	AA	1.68
355D(休 1)	102480721.IB	24 合高建设 MTN001	AA+	1.67
355D(休 1)	102480721.IB	24 合高建设 MTN001	AA+	1.67
361D+2Y	102480862.IB	24 丽水城投 MTN001	AA+	1.67 行权
1.01Y	102481087.IB	24 凤凰传媒 MTN002	AAA	1.63
1.01Y	102481087.IB	24 凤凰传媒 MTN002	AAA	1.63
1.01Y	102481088.IB	24 酒钢 MTN001(科创票据)	AAA	1.87
1.03Y(休 1)	102481275.IB	24 新运城发 MTN002	AA+	1.7
1.11Y	102481826.IB	24 宁波水务 MTN001(可持续挂钩)	AA+	1.69
1.14Y	102481887.IB	24 中建投租 MTN001	AAA	1.74
1.14Y	102481887.IB	24 中建投租 MTN001	AAA	1.74
1.33Y+NY	102501457.IB	25 晋能煤业 MTN010	AAA	1.86 行权
1.45Y	102483819.IB	24 国家能源 MTN001	AAA	1.66
1.47Y(休 2)	102483934.IB	24 静安投资 MTN002	AAA	1.74
1.47Y(休 2)	102483934.IB	24 静安投资 MTN002	AAA	1.74
1.5Y(休 1)	102282084.IB	22 苏交通 MTN006	AAA	1.68
1.52Y	102400962.IB	24 国电 MTN004	AAA	1.67
1.52Y	102400962.IB	24 国电 MTN004	AAA	1.67
1.6Y(休 2)	102484563.IB	24 宝城投 MTN002B	AA	2.15
1.61Y	102484670.IB	24 巩义新城 MTN002	AA+	2.01
1.75Y	102485443.IB	24 中石化 MTN004	AAA	1.69
1.75Y	102485443.IB	24 中石化 MTN004	AAA	1.69
1.75Y	102485443.IB	24 中石化 MTN004	AAA	1.69
1.77Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.7
1.81Y(休 1)	102580143.IB	25 大兴发展 MTN001	AAA	1.77
1.81Y(休 1)	102580143.IB	25 大兴发展 MTN001	AAA	1.77
1.81Y(休 1)	102580143.IB	25 大兴发展 MTN001	AAA	1.77
1.81Y(休 1)	102580143.IB	25 大兴发展 MTN001	AAA	1.77
1.81Y(休 1)	102580143.IB	25 大兴发展 MTN001	AAA	1.77
1.82Y	102380048.IB	23 宜昌高新 MTN001	AA+	1.84
1.83Y+2Y(休 1)	102580176.IB	25 世园投资 MTN001	AA	1.91 行权

1.83Y+2Y(休 1)	102580176.IB	25 世园投资 MTN001	AA	1.91 行权
1.83Y	102580195.IB	25 南宁轨交 MTN001	AAA	1.85
1.83Y(休 2)	102680175.IB	26 海尔金盈 MTN001	AAA	1.98
1.91Y(休 1)	102680595.IB	26 徐工租赁 MTN001(绿色)	AAA	1.87
1.98Y	102380433.IB	23 东台惠民 MTN001	AA	1.83
1.99Y+NY	102680849.IB	26 冀中能源 MTN005(科创债)	AAA	100.00 净价
2Y+1Y(休 2)	132680026.IB	26 华友钴业 GN004(科创债)	AA+	100.00 净价
2.02Y	102380674.IB	23 北控水集 MTN001B	AAA	1.82
2.02Y	102380674.IB	23 北控水集 MTN001B	AAA	1.82
2.08Y(休 1)	102581633.IB	25 镇江产投 MTN004	AAA	1.86
2.09Y	102581710.IB	25 国航 MTN003	AAA	1.77
2.09Y	102581710.IB	25 国航 MTN003	AAA	1.77
2.1Y	102380977.IB	23 长沙先导 MTN001	AAA	1.8
2.2Y+2Y	102582186.IB	25 德清交通 MTN001	AA+	1.88 行权
2.2Y+2Y	102582186.IB	25 德清交通 MTN001	AA+	1.88 行权
2.2Y+2Y	102582186.IB	25 德清交通 MTN001	AA+	1.88 行权
2.2Y+2Y	102582186.IB	25 德清交通 MTN001	AA+	1.88 行权
2.22Y	102582283.IB	25 苏州资产 MTN003	AAA	1.87
2.26Y+NY	102582532.IB	25 蓝星 MTN002	AAA	2 行权
2.33Y	102580336.IB	25 电网 MTN001	AAA	1.76
2.33Y	102580354.IB	25 电网 MTN002	AAA	1.76
2.39Y+NY	102583278.IB	25 宁河西 MTN003	AAA	1.99 行权
2.42Y	102583520.IB	25 昌平科技 MTN004	AA	1.97
2.42Y	102583520.IB	25 昌平科技 MTN004	AA	1.97
2.51Y	102583965.IB	25 深投控 MTN005	AAA	1.79
2.53Y	102584098.IB	25 招商蛇口 MTN004	AAA	2.145
2.53Y	102584098.IB	25 招商蛇口 MTN004	AAA	2.145
2.53Y	102584098.IB	25 招商蛇口 MTN004	AAA	2.145
2.53Y	102584098.IB	25 招商蛇口 MTN004	AAA	2.145
2.53Y	102584098.IB	25 招商蛇口 MTN004	AAA	2.145
2.53Y	102584098.IB	25 招商蛇口 MTN004	AAA	2.145
2.53Y	102584098.IB	25 招商蛇口 MTN004	AAA	2.145
2.53Y	102584098.IB	25 招商蛇口 MTN004	AAA	2.145
2.53Y	102584098.IB	25 招商蛇口 MTN004	AAA	2.145
2.54Y(休 9)	102584168.IB	25 闽漳龙 MTN003	AAA	1.94
2.59Y+2Y	102584254.IB	25 苏州高技 MTN007	AAA	2.00 行权
2.59Y+2Y	102584254.IB	25 苏州高技 MTN007	AAA	2.00 行权
2.62Y(休 1)	102584532.IB	25 丽水国资 MTN002	AA+	1.87
2.64Y+2Y	102584611.IB	25 红谷滩 MTN001	AA+	1.95 行权
2.7Y	102584994.IB	25 津城建 MTN015	AAA	1.96
2.7Y	102585011.IB	25 南航股 MTN014	AAA	1.81
2.76Y	102585291.IB	25 能建国际 MTN001	AAA	1.96
2.82Y+2Y	102480062.IB	24 诚通控股 MTN001A	AAA	1.81 行权
2.82Y	102601801.IB	26 光谷金控 MTN001(科创债)	AAA	1.94
2.89Y(休 1)	102680450.IB	26 河钢集 MTN003	AAA	2.03
2.89Y(休 1)	102680452.IB	26 沪港务 MTN001	AAA	1.8
2.89Y(休 1)	102680452.IB	26 沪港务 MTN001	AAA	1.8
2.9Y	102680512.IB	26 南昌交投 MTN001	AAA	1.89
2.97Y+NY	102680675.IB	26 中原高速 MTN001	AAA	1.98 行权
2.97Y	102680694.IB	26 越秀资本 MTN003	AAA	1.92
2.97Y	102680694.IB	26 越秀资本 MTN003	AAA	1.92
2.98Y	102680713.IB	26 厦国贸控 MTN004A	AAA	2.19
2.98Y	102680713.IB	26 厦国贸控 MTN004A	AAA	2.19
2.98Y+2Y	102680764.IB	26 临安国控 MTN001	AA+	1.91 行权
2.99Y	102680831.IB	26 黔晟国资 MTN001A(并购)	AAA	2.11

2.99Y	102680831.IB	26 黔晟国资 MTN001A(并购)	AAA	2.11
3Y	102680856.IB	26 平安租赁 MTN007	AAA	100.00 净价
3.08Y	102481508.IB	24 合建投 MTN003	AAA	1.86
3.08Y	102481508.IB	24 合建投 MTN003	AAA	1.86
3.12Y+NY(休 3)	102481863.IB	24 中电投 MTN003	AAA	1.91 行权
3.32Y	102482908.IB	24 江西交投 MTN009	AAA	1.85
3.4Y+NY	102483403.IB	24 中冶 MTN006	AAA	2.11 行权
3.42Y	102483530.IB	24 中兴通讯 MTN001(科创票 据)	AAA	2
3.6Y	102484524.IB	24 中电投 MTN024B	AAA	1.86
3.7Y	102485171.IB	24 国新控股 MTN003(稳增长 扩投资专项债)	AAA	1.87
3.94Y(休 1)	102580751.IB	25 锡产业 MTN001(混合型科 创票据)	AAA	1.94
3.94Y(休 1)	102580751.IB	25 锡产业 MTN001(混合型科 创票据)	AAA	1.94
4.22Y	102582268.IB	25 汇金 MTN003	AAA	1.92
4.22Y	102582268.IB	25 汇金 MTN003	AAA	1.92
4.35Y(休 1)	102580431.IB	25 电网 MTN012	AAA	1.93
4.35Y(休 1)	102580431.IB	25 电网 MTN012	AAA	1.93
4.38Y(休 1)	102501506.IB	25 鄂联投 MTN006A	A+	2.35
4.6Y+NY	102584398.IB	25 陕延油 MTN003(科创债)	AAA	2.15 行权
4.6Y+NY	102584398.IB	25 陕延油 MTN003(科创债)	AAA	2.15 行权
4.88Y	102601811.IB	26 山东铁投 MTN001B	AAA	1.97
4.91Y	102680579.IB	26 中节能 MTN001B(科创债)	AAA	2.03
4.91Y	102680579.IB	26 中节能 MTN001B(科创债)	AAA	2.03
4.91Y	102680579.IB	26 中节能 MTN001B(科创债)	AAA	2.03
5.1Y	102584376.IB	25 电网 MTN033	AAA	1.945
5.1Y	102584376.IB	25 电网 MTN033	AAA	1.945
5.1Y	102584378.IB	25 电网 MTN034	AAA	1.945
7.87Y(休 1)	102480319.IB	24 诚通控股 MTN004A	AAA	2.3
7.87Y(休 1)	102480319.IB	24 诚通控股 MTN004A	AAA	2.3
8.34Y	102483094.IB	24 蜀道投资 MTN010A	AAA	2.35
8.39Y(休 2)	102483305.IB	24 中铁建 MTN001	AAA	2.3
9.86Y(休 1)	102680343.IB	26 诚通控股 MTN001A(科创 债)	AAA	2.38
9.97Y	102680677.IB	26 中关村集 MTN001B	AAA	2.46
9.97Y	102680677.IB	26 中关村集 MTN001B	AAA	2.46
9.97Y	102680677.IB	26 中关村集 MTN001B	AAA	2.46
28.18Y	102481988.IB	24 铁道 MTN003B	AAA	2.515
28.18Y	102481988.IB	24 铁道 MTN003B	AAA	2.515

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（%）
21D	068015.IB	06 鲁高速债	AAA	1.7
30D	175994.SH	21 东证 C3	AAA	1.56
41D+NY(休 1)	2380126.IB	23 蓉高可续期 01	AAA	1.71 行权
70D	188155.SH	21 济城 G3	AAA	1.65
85D+5Y	2123010.IB	21 中信保诚人寿	AAA	1.59 行权
88D(休 2)	243153.SH	25 京东 SK	AAA	1.67
125D	2322005.IB	23 奔驰汽车债 01	AAA	1.57
133D	149575.SZ	21 申证 09	AAA	1.53
141D	188519.SH	21 建材 04	AAA	1.65
147D	241260.SH	24 国君 G2	AAA	1.53
147D	241260.SH	24 国君 G2	AAA	1.54
153D	148430.SZ	23 申证 04	AAA	1.53
154D+2Y	115808.SH	23 紫金 G1	A-	1.63 行权

154D	252380002.IB	23 东方债 01BC	AAA	1.55
163D	1980254.IB	19 长交绿色债 01	AA+	1.75
174D+2Y	115924.SH	23 海国 05	AAA	1.67 行权
181D	115967.SH	23 银河 G5	AAA	1.53
251D	240285.SH	23 豫管 02	AAA	1.72
256D(休 2)	240341.SH	23 华鑫 02	AA+	1.6
256D(休 2)	240341.SH	23 华鑫 02	AA+	1.6
266D	240390.SH	23 上金 K2	AAA	1.66
266D	240390.SH	23 上金 K2	AAA	1.66
266D	240390.SH	23 上金 K2	AAA	1.66
278D(休 1)	184170.SH	21 皖交 02	AAA	1.62
278D(休 1)	240408.SH	23 中证 30	AAA	1.55
284D(休 2)	032381255.IB	23 历下控股 PPN002	AAA	1.77
306D(休 1)	149780.SZ	22 广铁 01	AAA	1.62
306D(休 1)	149780.SZ	22 广铁 01	AAA	1.62
306D(休 1)	149780.SZ	22 广铁 01	AAA	1.62
307D	240506.SH	24 招证 G1	AAA	1.55
308D	240505.SH	24 中证 G2	AAA	1.55
346D	240590.SH	24 首集 K1	AAA	1.67
355D(休 1)	2422007.IB	24 招银金租债 01	AAA	1.6
360D+2Y	254047.SH	24 左海 01	AAA	1.68 行权
361D(休 2)	254054.SH	24 博乐 01	AA	2.03
361D(休 2)	254054.SH	24 博乐 01	AA	2.03
1.04Y	163322.SH	20 温交 01	AAA	1.67
1.07Y+NY(休 1)	240878.SH	24 甬投 Y1	AAA	1.76 行权
1.11Y+NY	240961.SH	金隅 KY06	AAA	1.86 行权
1.13Y+5Y	184363.SH	22 乌城 01	AAA	1.65 行权
1.13Y+5Y	184363.SH	22 乌城 01	AAA	1.65 行权
1.18Y+NY(休 1)	185808.SH	22CHNG2Y	AAA	1.67 行权
1.18Y(休 1)	254815.SH	24 唐山 02	AAA	2.02
1.18Y(休 1)	254815.SH	24 唐山 02	AAA	2.02
1.24Y	241066.SH	24 大兴 01	AAA	1.7
1.25Y	281333.SH	26 华泰 F2	AAA	1.69
1.27Y+NY	149958.SZ	22 光大 Y4	AAA	1.72 行权
1.53Y	2080287.IB	20 晋江城投债 02	AA+	1.74
1.58Y	256002.SH	24 江科 04	AA	1.84
1.6Y(休 1)	241778.SH	24 国证 G1	AAA	1.685
1.7Y	138664.SH	22 中金 G1	AAA	1.64
1.76Y(休 1)	242129.SH	24 华安 C3	AAA	1.76
1.76Y(休 1)	242129.SH	24 华安 C3	AAA	1.76
1.76Y(休 1)	242129.SH	24 华安 C3	AAA	1.76
1.82Y+NY	242210.SH	25 新汶 Y1	AAA	1.83 行权
1.9Y	524670.SZ	26 申证 03	AAA	1.73
1.98Y(休 2)	152773.SH	21 江北 01	AAA	1.8
1.98Y(休 2)	175809.SH	21 温交 01	AAA	1.81
1.98Y(休 2)	175809.SH	21 温交 01	AAA	1.81
1.98Y(休 2)	175809.SH	21 温交 01	AAA	1.81
2.02Y+NY(休 2)	258016.SH	25 瀚控 Y1	AA+	2.12 行权
2.08Y	242785.SH	25 苏交 02	AAA	1.72
2.1Y	242869.SH	25 东吴 01	AAA	1.735
2.11Y	242860.SH	25 闽能 02	AAA	1.72
2.11Y	242860.SH	25 闽能 02	AAA	1.72
2.14Y(休 1)	242916.SH	25 北控 K1	AAA	1.71
2.18Y	115381.SH	23 洪轨 02	AAA	1.815
2.19Y+2Y(休 1)	115395.SH	23 兴沪 02	AA+	1.84 行权

2.19Y+2Y(休 1)	115395.SH	23 兴沪 02	AA+	1.84 行权
2.22Y	148308.SZ	23 鄂交 K4	AAA	1.76
2.24Y	243138.SH	25 华安 C1	AAA	1.82
2.32Y	243260.SH	25 中泰 02	AAA	1.76
2.36Y	115619.SH	23 海通 14	AAA	1.72
2.36Y	115619.SH	23 海通 14	AAA	1.72
2.44Y	243524.SH	25 北控 K3	AAA	1.75
2.51Y	280010.SH	25 洪产 05	AAA	2.03
2.62Y	244114.SH	25 招证 C1	AAA	1.85
2.62Y	244114.SH	25 招证 C1	AAA	1.85
2.74Y+NY	244317.SH	化学 YK05	AAA	1.91 行权
2.82Y	244509.SH	26 青信 01	AAA	1.9
2.84Y	2280010.IB	22 黄石城发债 01	AA+	2
2.85Y	244556.SH	26 新证 C1	AAA	2.09
2.85Y	244556.SH	26 新证 C1	AAA	2.09
2.87Y+2Y	134818.SZ	26 金象 01	AA+	2.45 行权
2.89Y	2622001.IB	26 华夏金租债 01	AAA	1.845
2.97Y	244720.SH	26 经发 K1	AAA	1.88
2.98Y	032400642.IB	24 常城建 PPN001	AAA	2.02
2.98Y+NY(休 2)	244773.SH	建工 KY18	AAA	2.16 行权
2.98Y+NY(休 2)	244773.SH	建工 KY18	AAA	2.16 行权
2.98Y+NY(休 2)	244773.SH	建工 KY18	AAA	2.16 行权
2.98Y+NY(休 2)	244773.SH	建工 KY18	AAA	2.16 行权
2.98Y+NY(休 2)	244773.SH	建工 KY18	AAA	2.16 行权
2.98Y(休 1)	244766.SH	26 华鲁 K1	AAA	1.87
2.98Y(休 1)	244766.SH	26 华鲁 K1	AAA	1.88
2.98Y(休 1)	244766.SH	26 华鲁 K1	AAA	1.88
2.98Y(休 1)	244766.SH	26 华鲁 K1	AAA	1.88
2.98Y+2Y	244812.SH	26 长发 02	AAA	1.86 行权
2.98Y+2Y	244812.SH	26 长发 02	AAA	1.86 行权
3.08Y+NY(休 1)	240893.SH	24 首钢 Y2	AAA	1.95 行权
3.25Y+NY(休 1)	282400001.IB	24 太保寿险永续债 01	AAA	1.95 行权
3.38Y+NY	241370.SH	焦煤 YK01	AAA	1.89 行权
3.45Y	148875.SZ	24 广资 04	AAA	2.17
3.53Y+5Y	272400007.IB	24 中国人寿资本补充债 01BC	AAA	1.97 行权
3.91Y	242372.SH	25 中飞 02	AAA	2.42
3.91Y	242372.SH	25 中飞 02	AAA	2.42
4Y	242528.SH	25 扬州 G1	AAA	1.95
4.03Y+NY	282500008.IB	25 工银安盛永续债 01	AAA	2.18 行权
4.1Y	524253.SZ	25 蓉金 G1	AAA	1.95
4.15Y+5Y(休 2)	258545.SH	25 济能 01	AAA	2.24 行权
4.31Y+NY(休 1)	243264.SH	中化 KY01	AAA	2.19 行权
4.31Y+NY(休 1)	243264.SH	中化 KY01	AAA	2.19 行权
4.31Y+NY(休 1)	243264.SH	中化 KY01	AAA	2.19 行权
4.31Y+NY(休 1)	243264.SH	中化 KY01	AAA	2.19 行权
4.43Y	259814.SH	25 郑高 01	AA+	2.43
4.69Y(休 1)	244291.SH	25 船舶 K3	AAA	1.88
4.69Y(休 1)	244291.SH	25 船舶 K3	AAA	1.88
4.69Y(休 1)	244291.SH	25 船舶 K3	AAA	1.88
4.69Y(休 1)	244291.SH	25 船舶 K3	AAA	1.88
4.71Y(休 1)	134674.SZ	25 晋投 01	AAA	2.3
4.74Y+5Y	272580009.IB	25 平安人寿资本补充债 01	AAA	2.27 行权
4.74Y+5Y	272580009.IB	25 平安人寿资本补充债 01	AAA	2.27 行权
4.74Y+5Y	272580009.IB	25 平安人寿资本补充债 01	AAA	2.27 行权
4.85Y	281407.SH	26 平发 01	AA+	2.69

4.9Y+NY(休 1)	244708.SH	26 中化 Y2	AAA	2.32 行权
4.97Y	524688.SZ	26 广铁 K2	AAA	1.92
4.98Y+NY(休 1)	244734.SH	葛洲 YK14	AAAsti	2.06 行权
4.98Y+NY(休 1)	244734.SH	葛洲 YK14	AAAsti	2.06 行权
5Y	244853.SH	26 皖投 01		1.97
9.85Y	2680006.IB	26 铁道 02	AAA	2.045
35D+NY	2128016.IB	21 民生银行永续债 01	AAA	1.555 行权
35D+NY	2128016.IB	21 民生银行永续债 01	AAA	1.56 行权
35D+NY	2128016.IB	21 民生银行永续债 01	AAA	1.56 行权
74D(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	1.58
74D(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	1.58
74D(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	1.585
83D+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	1.54 行权
97D+NY	2121030.IB	21 张家港农商行永续债	AA+	1.67 行权
118D+NY	2120064.IB	21 恒丰银行永续债	AAA	1.6 行权
118D+NY	2120064.IB	21 恒丰银行永续债	AAA	1.6 行权
118D+NY	2120064.IB	21 恒丰银行永续债	AAA	1.6 行权
119D	2320027.IB	23 东莞银行	AAA	1.57
125D	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	1.525
125D	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	1.525
131D(休 1)	212380013.IB	23 浙商银行债 01	AAA	1.56
146D+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	1.585 行权
146D+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	1.585 行权
164D	2321026.IB	23 上海农商 01	AAA	1.55
178D	2321029.IB	23 东莞农商小微债 01	AAA	1.56
235D(休 2)	2328023.IB	23 浙商银行小微债 02	AAA	1.56
235D(休 2)	2328023.IB	23 浙商银行小微债 02	AAA	1.56
235D(休 2)	2328023.IB	23 浙商银行小微债 02	AAA	1.56
268D+5Y	2120113.IB	21 吉林银行二级	AAA	2.13 行权
268D+5Y	2120113.IB	21 吉林银行二级	AAA	2.13 行权
273D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.585 行权
309D+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.59 行权
313D+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.59 行权
313D+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.59 行权
313D+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.59 行权
345D+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	1.59 行权
356D+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	1.59 行权
356D	2426003.IB	24 南洋银行 03	AAA	1.62
1.01Y	212480005.IB	24 光大银行债 01	AAA	1.5575
1.07Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	1.59 行权
1.07Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	1.6 行权
1.07Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	1.6 行权
1.07Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	1.6 行权
1.08Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	1.60 行权
1.11Y(休 1)	212400004.IB	24 光大银行小微债	AAA	1.565
1.17Y	212480011.IB	24 浙商银行小微债 03	AAA	1.6
1.17Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.62 行权
1.25Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	1.62 行权
1.26Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AA+	1.625 行权
1.26Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AA+	1.625 行权
1.26Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AA+	1.625 行权
1.32Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.585
1.32Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.585
1.32Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.585
1.35Y+5Y	092280021.IB	22 上海农商行二级资本债 02	AAA	1.67 行权

1.43Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	1.595
1.46Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	1.655 行权
1.46Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	1.655 行权
1.53Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	AAA	1.6
1.53Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	AAA	1.6
1.54Y+5Y	092280098.IB	22 杭州银行二级资本债 01	AAA	1.69 行权
1.54Y+5Y	092280098.IB	22 杭州银行二级资本债 01	AAA	1.69 行权
1.65Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	1.655 行权
1.93Y	2520001.IB	25 北京银行小微债 01	AAA	1.65
1.95Y	2528004.IB	25 农业银行绿色债 01	AA+	1.6
1.95Y	2528004.IB	25 农业银行绿色债 01	AA+	1.6
1.95Y	2528004.IB	25 农业银行绿色债 01	AA+	1.6
2.03Y	2528006.IB	25 中信银行小微债	AAA	1.64
2.06Y(休 2)	212580007.IB	25 浙商银行小微债 01BC	AAA	1.67
2.06Y(休 2)	212580007.IB	25 浙商银行小微债 01BC	AAA	1.6725
2.12Y	2528007.IB	25 浦发银行 01	AAA	1.655
2.16Y(休 2)	332580002.IB	25 兴业银行科创债 01	AAA	1.65
2.16Y(休 2)	332580002.IB	25 兴业银行科创债 01	AAA	1.65
2.16Y	2528010.IB	25 农业银行科创债	AA+	1.64
2.16Y	2528010.IB	25 农业银行科创债	AA+	1.64
2.18Y(休 2)	2520012.IB	25 上海银行科创债 01	AAA	100.00 净价
2.18Y(休 2)	2520012.IB	25 上海银行科创债 01	AAA	100.00 净价
2.18Y(休 2)	2520012.IB	25 上海银行科创债 01	AAA	100.00 净价
2.19Y(休 3)	2520014.IB	25 北京银行科创债 01	AAA	100.00 净价
2.19Y(休 3)	2520014.IB	25 北京银行科创债 01	AAA	100.00 净价
2.19Y(休 3)	2520014.IB	25 北京银行科创债 01	AAA	100.00 净价
2.21Y(休 2)	2520016.IB	25 徽商银行 01	AAA	1.695
2.21Y(休 2)	2520016.IB	25 徽商银行 01	AAA	1.7
2.25Y+NY	242380008.IB	23 中行永续债 01	AAA	1.775 行权
2.32Y+1Y	312510006.IB	25 中行 TLAC 非资本债 01(BC)	AAA	1.735 行权
2.32Y+1Y	312510006.IB	25 中行 TLAC 非资本债 01(BC)	AAA	1.74 行权
2.32Y+1Y	312510006.IB	25 中行 TLAC 非资本债 01(BC)	AAA	1.74 行权
2.42Y+1Y(休 1)	312510012.IB	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	AAA	1.80 行权
2.42Y+1Y(休 1)	312510012.IB	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	AAA	1.80 行权
2.44Y+5Y	232380033.IB	23 成都银行二级资本债 01	AAA	1.82 行权
2.44Y+5Y	232380033.IB	23 成都银行二级资本债 01	AAA	1.82 行权
2.44Y+5Y	232380033.IB	23 成都银行二级资本债 01	AAA	1.82 行权
2.44Y+5Y	232380033.IB	23 成都银行二级资本债 01	AAA	1.82 行权
2.44Y+5Y	232380033.IB	23 成都银行二级资本债 01	AAA	1.82 行权
2.49Y	2520040.IB	25 贵阳银行小微债 01	AAA	1.775
2.49Y	2520040.IB	25 贵阳银行小微债 01	AAA	1.775
2.52Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	1.76 行权
2.6Y+5Y(休 1)	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A	AAA	1.78 行权
2.6Y+5Y(休 1)	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A	AAA	1.78 行权
2.6Y+5Y(休 1)	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A	AAA	1.78 行权
2.6Y+5Y(休 1)	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A	AAA	1.78 行权
2.61Y+1Y	312510013.IB	25 工行 TLAC 非资本债 01BC	AAA	1.825 行权
2.61Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.775 行权
2.61Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.775 行权
2.63Y	212580033.IB	25 厦门国际银行债 02	AAA	1.83
2.63Y	212580033.IB	25 厦门国际银行债 02	AAA	1.83
2.65Y	212580037.IB	25 光大银行债 03	AAA	1.7
2.65Y	212580037.IB	25 光大银行债 03	AAA	1.7
2.65Y	212580037.IB	25 光大银行债 03	AAA	1.7
2.65Y	212580037.IB	25 光大银行债 03	AAA	1.7

2.65Y	212580037.IB	25 光大银行债 03	AAA	1.7
2.65Y	212580037.IB	25 光大银行债 03	AAA	1.71
2.66Y(休 1)	212580038.IB	25 赣州银行小微债 01	AA+	1.81
2.66Y(休 1)	212580038.IB	25 赣州银行小微债 01	AA+	1.81
2.66Y	2528025.IB	25 浦发银行绿色债 01	AAA	1.69
2.67Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	1.78 行权
2.67Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	1.78 行权
2.67Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	1.78 行权
2.67Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	1.7875 行权
2.67Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	1.7875 行权
2.67Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	1.7875 行权
2.71Y	212580050.IB	25 兴业银行债 01	AAA	1.71
2.74Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.71
2.74Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.71
2.76Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	1.81 行权
2.88Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	1.8125 行权
2.89Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.8125 行权
2.89Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.8125 行权
2.89Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.8125 行权
2.89Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.8125 行权
2.89Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.8125 行权
2.99Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AA+	1.885 行权
2.99Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AA+	1.885 行权
2.99Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AA+	1.885 行权
2.99Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AA+	1.885 行权
3Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	1.885 行权
3.07Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AA+	1.84 行权
3.1Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	1.935 行权
3.1Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	1.935 行权
3.22Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AA+	1.9275 行权
3.22Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AA+	1.9275 行权
3.22Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AA+	1.93 行权
3.26Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.995 行权
3.26Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.995 行权
3.26Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.995 行权
3.26Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.995 行权
3.26Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.995 行权
3.26Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.995 行权
3.26Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.995 行权
3.26Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.995 行权
3.31Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	1.88 行权
3.32Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	1.925 行权
3.32Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	1.94 行权
3.32Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	1.94 行权
3.39Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	1.94 行权
3.39Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	1.94 行权
3.39Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	1.94 行权
3.41Y+5Y(休 2)	232400034.IB	24 杭州银行二级资本债 01	AAA	1.94 行权
3.41Y+5Y(休 2)	232400034.IB	24 杭州银行二级资本债 01	AAA	1.94 行权
3.41Y+1Y	312410004.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01B	AAA	1.86 行权
3.42Y+NY(休 1)	242400016.IB	24 民生银行永续债 01	AAA	2.19 行权
3.44Y+5Y	232400035.IB	24 南京银行二级资本债 01	AAA	1.94 行权
3.44Y+5Y	232400035.IB	24 南京银行二级资本债 01	AAA	1.94 行权
3.44Y+5Y	232400035.IB	24 南京银行二级资本债 01	AAA	1.94 行权
3.44Y+5Y	232400035.IB	24 南京银行二级资本债 01	AAA	1.94 行权
3.44Y+5Y	232400036.IB	24 南京银行二级资本债 02	AAA	1.94 行权

3.44Y+5Y	232400036.IB	24 南京银行二级资本债 02	AAA	1.945 行权
3.44Y+NY(休 1)	242400019.IB	24 江苏银行永续债 02	AAA	2.03 行权
3.45Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.905 行权
3.52Y+5Y(休 2)	232400037.IB	24 宁波银行二级资本债 02	AAA	1.95 行权
3.52Y+5Y(休 2)	232400037.IB	24 宁波银行二级资本债 02	AAA	1.95 行权
3.52Y+5Y(休 2)	232400037.IB	24 宁波银行二级资本债 02	AAA	1.95 行权
3.52Y+5Y(休 2)	232400037.IB	24 宁波银行二级资本债 02	AAA	1.95 行权
3.7Y+NY	242480082.IB	24 农行永续债 03BC	AA+	2.01 行权
3.7Y+NY	242480082.IB	24 农行永续债 03BC	AA+	2.01 行权
3.73Y+5Y(休 1)	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A	AAA	1.97 行权
3.73Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	AAA	2.015 行权
3.79Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.965 行权
3.79Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.965 行权
3.96Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	1.995 行权
3.96Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	1.995 行权
3.96Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	1.995 行权
3.96Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	1.995 行权
3.96Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	1.995 行权
3.97Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	2.145 行权
3.97Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	2.145 行权
3.97Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	2.145 行权
4.03Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.0075 行权
4.03Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.0075 行权
4.08Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.13 行权
4.08Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.13 行权
4.08Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.13 行权
4.08Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.135 行权
4.08Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.135 行权
4.11Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	2.225 行权
4.12Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.02 行权
4.12Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.02 行权
4.12Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.02 行权
4.12Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.02 行权
4.12Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.02 行权
4.12Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.02 行权
4.12Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.02 行权
4.12Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.0225 行权
4.16Y+NY	242580011.IB	25 工行永续债 01BC	AAA	2.08 行权
4.16Y+NY	242580011.IB	25 工行永续债 01BC	AAA	2.08 行权
4.16Y+NY	242580011.IB	25 工行永续债 01BC	AAA	2.08 行权
4.17Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.08 行权
4.17Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.08 行权
4.17Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.08 行权
4.2Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AA+	2.0825 行权
4.2Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AA+	2.0825 行权
4.2Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AA+	2.085 行权
4.2Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AA+	2.085 行权
4.2Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AA+	2.085 行权
4.2Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AA+	2.0875 行权
4.2Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AA+	2.0875 行权
4.2Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AA+	2.0875 行权
4.2Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AA+	2.0875 行权
4.23Y+5Y(休 2)	232580014.IB	25 吉林银行二级资本债 02	AAA	2.77 行权
4.23Y+5Y(休 2)	232580014.IB	25 吉林银行二级资本债 02	AAA	2.77 行权
4.24Y	332580008.IB	25 南京银行科创债 01BC	AAA	1.77

4.33Y+5Y(休 2)	232580022.IB	25 工行二级资本债 03BC	AAA	2.0425 行权
4.33Y+5Y(休 2)	232580022.IB	25 工行二级资本债 03BC	AAA	2.0425 行权
4.33Y+NY	242580027.IB	25 广州银行永续债 01	AAA	2.27 行权
4.33Y+NY	242580027.IB	25 广州银行永续债 01	AAA	2.27 行权
4.33Y+NY	242580027.IB	25 广州银行永续债 01	AAA	2.27 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.0475 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.0475 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.0475 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.0475 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.05 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.05 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.05 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.05 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.05 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.05 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.05 行权
4.35Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AA+	2.05 行权
4.35Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.1 行权
4.35Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.11 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.0475 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.0475 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.0475 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.0475 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.0475 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.05 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.05 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.05 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.05 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.05 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.05 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.05 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.05 行权
4.36Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.05 行权
4.44Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.155 行权
4.44Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.155 行权
4.44Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.155 行权
4.49Y+NY	242580038.IB	25 兴业银行永续债 02BC	AAA	2.195 行权
4.5Y+NY	242580042.IB	25 宁波银行永续债 01	AAA	2.22 行权
4.5Y+NY	242580042.IB	25 宁波银行永续债 01	AAA	2.22 行权
4.5Y+NY	242580042.IB	25 宁波银行永续债 01	AAA	2.23 行权
4.51Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.11 行权
4.62Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AA+	2.1625 行权
4.62Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AA+	2.165 行权
4.62Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AA+	2.1675 行权
4.62Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AA+	2.1675 行权
4.62Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AA+	2.1675 行权
4.62Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AA+	2.1675 行权
4.62Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AA+	2.1675 行权
4.62Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AA+	2.1675 行权
4.65Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.165 行权
4.65Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.165 行权
4.68Y+5Y	232580044.IB	25 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.1625 行权
4.68Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+	2.12 行权
4.68Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+	2.1225 行权
4.68Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.27 行权
4.68Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.27 行权
4.68Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.27 行权

4.68Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.27 行权
4.68Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.27 行权
4.7Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.115 行权
4.7Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.12 行权
4.7Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.1225 行权
4.7Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.1275 行权
4.73Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.125 行权
4.73Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.125 行权
4.75Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.205 行权
4.77Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.13 行权
4.77Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.1325 行权
5.75Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.19 行权
9.51Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AA+	2.49 行权
9.51Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AA+	2.49 行权
9.51Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AA+	2.49 行权

免责声明：本日报由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用日报内容。日报所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，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，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本日报任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。