



【2024-03-01】

国债

3月1日，央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，3月1日以利率招标方式开展100亿元7天期逆回购操作，中标利率为1.80%。

Wind 数据显示，当日有2470亿元逆回购到期，因此单日净回笼2370亿元。本周央行共开展11640亿元逆回购操作，同时有5320亿元逆回购到期，实现净投放6320亿元。此外，2月28日有50亿元央票互换（CBS）到期，央行于当日开展50亿元3个月期CBS操作。

国债方面 238D 230024 1.76-77； 1.04Y 230005 1.90-92； 2.72Y 230025 2.14-15； 4.63Y 230022 2.2225-2625； 6.83Y 230028 2.35-39； 9.75Y 230026 2.355-387； 29.13Y 230009 2.485-525。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.7500	2.1000	2.2250	2.3475	2.3850	2.4825
今日国债(%)	1.7700	2.1450	2.2675	2.3825	2.4175	2.5100
变动(%)	0.0200	0.0450	0.0425	0.0350	0.0325	0.0275

金融债

金融债方面 194D(休2) 230211 1.80； 331D 240301 1.80-82； 2.99Y 220203 2.22-255； 4.55Y 230415 2.36-38； 6.3Y 200210 2.45； 9.54Y 230215 2.5125-5475。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.7700	2.2150	2.3350	2.4975	2.5250
今日非国开金融债(%)	1.7700	2.2450	2.3800	2.5100	2.5575
变动(%)	0.0000	0.0300	0.0450	0.0125	0.0325
昨日国开债(%)	1.8100	2.1850	2.2725	2.4201	2.4825
今日国开债(%)	1.8100	2.2450	2.3150	2.4700	2.5175
变动(%)	0.0000	0.0600	0.0425	0.0499	0.0350

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Q2、Q3期限。短端方面，11D 012382292.IB 23中铝集 SCP002 AAA 在2.15%成交（估值-9位置），银行出给基金；28D 012480378.IB 24中建三局 SCP003(科创票据) AAA 在2.22%净价成交（估值-2位置），银行出给基金。中长端方面，133D 012480328.IB 24电网 SCP002 AAA 在2.22%成交（估值+1位置），银行出给券商；161D 012384084.IB 23深圳地铁 SCP007 AAA 在2.28%成交（估值位置），银行出给基金。长端方面，206D 042380712.IB 23桂交投 CP009 AAA 在2.41%成交（估值-4位置），银行出给基金；238D 012480395 24格力 SCP002 AAA 在2.35%成交（估值-1位置），理财出给券商。总体而言，短端、中长端和长端收益均保持震荡。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	2.24		2.32		2.38		2.46		2.54	
	AA+	2.42		2.51		2.58		2.67		2.71	
	AA	2.75		2.99		3.0		3.32		3.35	
	AA-	3.09		3.66		3.78		4.35		4.48	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	2.26	-2	2.33	-1	2.38	0	2.49	-3	2.56	-2
	AA+	2.44	-2	2.52	-1	2.59	-1	2.67	0	2.72	-1
	AA	2.75	0	2.99	0	3.0	0	3.32	0	3.35	0
	AA-	3.09	0	3.66	0	3.78	0	4.35	0	4.48	0

中期票据

今日中票交投情绪一般。1-3年短端中票，多为估值-1~估值+1成交，在2.5Y附近较为集中，22中电投 MTN023（AAA，1.42Y）在2.35%成交2笔；23汇金 MTN002（AAA，2.14Y）成交在2.39%；23苏交通 MTN004（AAA，2.52Y）在2.49%成交3笔；24南电 MTN001（AAA，3.00Y）在

2.42%成交多笔。3 到 5 年期限，成交较少，24 广州地铁 MTN002（AAA，4.93Y）日内成交收益率从 2.68%上行至 2.70%。5Y 及以上期限，成交尚可，23 济南城建 MTN003（AAA，9.54Y）成交在 3.11%，较昨日上行 1bp；24 中冶 MTN001（AAA，9.98Y）在 2.94%成交多笔。总体而言，今日中票收益率日内略有上行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.33		2.51		2.69		2.81		None	
	AAA	2.44		2.6		2.82		None		None	
	AA+	2.5		2.85		3.03		None		None	
	AA	2.69		2.93		3.23		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.3	3	2.5	1	2.67	2	2.8	1	None	None
	AAA	2.42	2	2.58	2	2.8	2	None	None	None	None
	AA+	2.48	2	2.84	1	3.03	0	None	None	None	None
	AA	2.69	0	2.93	0	3.23	0	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，20 建材 01AAA 成交在 2.34%，基金卖出，基金买入。23 长轨 G4 AAA 成交在 2.61%。23 吉利 K1 AAA 成交在 2.84%，基金卖出，理财买入。城投方面，16 贵阳停车场债 02 AAA 成交在 3.18%。19 首旅债 02 AAA 成交在 2.79%，券商卖出，保险买入。20 吉安绿色债 AAA 成交在 2.89%。长端方面，20 津投 10 AAA 成交在 3.70%。23 鄂交 K3 AAA 成交在 2.81%。

美元债

周五买盘情绪转好。投资级方面，新发的陕金资调动老券出现卖盘，投资者重新关注 1 年以内到期券。城投板块，点心债价值凸显，近期新发的建德国资、涪陵实业均有交投。地产板块，金地受利好消息带动上涨 1-2pt，早盘成交在 72 附近，万达、新城等上涨 0.25-0.5pt，万科曲线继续下跌 0.5-1pt。

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
11D	012383191.IB	23 武钢集 SCP005	AAA	2.19%
11D	012480251.IB	24 津城建 SCP002	AAA	2.45%
11D	012382259.IB	23 津城建 SCP038	AAA	2.45%
11D	072310061.IB	23 中信建投 CP007	AAA	1.90%
11D	012382259.IB	23 津城建 SCP038	AAA	2.36%
11D	012382292.IB	23 中铝集 SCP002	AAA	2.15%
17D	012383523.IB	23 赣出版 SCP005	AAA	2.23%
17D	012480652.IB	24 陕延油 SCP001	AAA	2.13%
17D	012480652.IB	24 陕延油 SCP001	AAA	2.13%
17D	012480652.IB	24 陕延油 SCP001	AAA	2.15%
17D	012480652.IB	24 陕延油 SCP001	AAA	2.15%
21D	012480114.IB	24 蒙牛 SCP002	AAA	2.20%
21D	012480560.IB	24 中化股 SCP001	AAA	2.15%
28D	012480160.IB	24 中电路桥 SCP001	AAA	2.10%
28D	012480160.IB	24 中电路桥 SCP001	AAA	2.10%
28D	012480160.IB	24 中电路桥 SCP001	AAA	2.10%
28D	012480054.IB	24 中兴通讯 SCP003	AAA	2.21%
28D	012480240.IB	24 中兴通讯 SCP014	AAA	2.22%
28D	012480156.IB	24 中兴通讯 SCP007	AAA	2.22%
28D	012480240.IB	24 中兴通讯 SCP014	AAA	2.22%
28D	012480378.IB	24 中建三局 SCP003(科创票据)	AAA	2.22%
28D	012480378.IB	24 中建三局 SCP003(科创票据)	AAA	2.22%
45D	012383791.IB	23 鲁高速 SCP005	AAA	2.26%
51D(休 1)	012382788.IB	23 南电 SCP013	AAA	2.22%
54D	012480640.IB	24 中建八局 SCP004	AAA	2.25%
54D	012480640.IB	24 中建八局 SCP004	AAA	2.25%
54D	012480640.IB	24 中建八局 SCP004	AAA	2.25%
55D	012384586.IB	23 酒钢 SCP001	AA+	2.50%
72D(休 1)	012383047.IB	23 未来科技 SCP006	AA	2.40%
72D(休 1)	012383065.IB	23 国新保理 SCP003	AAA	2.34%
116D	012480246.IB	24 中建一局 SCP001(科创票据)	AAA	2.30%
117D	012480597.IB	24 中材科技 SCP001	AAA	2.31%
138D	012480255.IB	24 隧道股份 SCP001	AAA	2.33%
142D(休 1)	012384261.IB	23 鄂联投 SCP004	AAA	2.38%
161D	012384084.IB	23 深圳地铁 SCP007	AAA	2.28%
206D	042380712.IB	23 桂交投 CP009	AAA	2.41%

206D	042380712.IB	23 桂交投 CP009	AAA	2.41%
261D(休 1)	012480546.IB	24 昆山国创 SCP001	AA+	2.41%
261D(休 1)	012480546.IB	24 昆山国创 SCP001	AA+	2.41%
261D(休 1)	012480546.IB	24 昆山国创 SCP001	AA+	2.41%
261D(休 1)	012480546.IB	24 昆山国创 SCP001	AA+	2.41%
266D	012480614.IB	24 济南城建 SCP003	AAA	2.34%
266D	012480614.IB	24 济南城建 SCP003	AAA	2.34%
266D	012480614.IB	24 济南城建 SCP003	AAA	2.34%
266D	012480614.IB	24 济南城建 SCP003	AAA	2.34%
266D	012480614.IB	24 济南城建 SCP003	AAA	2.34%
266D	012480614.IB	24 济南城建 SCP003	AAA	2.34%
266D	012480614.IB	24 济南城建 SCP003	AAA	2.34%
281D(休 2)	042380728.IB	23 建安投资 CP003	AA+	2.48%
358D(休 2)	042480088.IB	24 津城建 CP001	AAA	2.53%

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
11D	102100411.IB	21 兖矿 MTN002	AAA	2.20%
14D	101900332.IB	19 长电 MTN001	AAA	2.12%
32D	101900454.IB	19 首旅 MTN001	AAA	2.24%
32D	101900454.IB	19 首旅 MTN001	AAA	2.24%
48D	102280810.IB	22 远东租赁 MTN002	AAA	2.44%
50D(休 2)	102100732.IB	21 苏州国际 MTN001	AAA	2.36%
70D+NY	101900708.IB	19 招商局 MTN004B	AAA	2.38%
98D	102101032.IB	21 南通沿海 MTN001	AAA	2.35%
108D+1.99Y	102101088.IB	21 武汉城建 MTN001	AAA	2.30%
108D+1.99Y	102101088.IB	21 武汉城建 MTN001	AAA	2.30%
120D(休 2)	102101219.IB	21 蚌埠投资 MTN001	AA	2.50%
130D	102101263.IB	21 巨化 MTN002	AA+	2.39%
136D	102101299.IB	21 苏国信 MTN006	AAA	2.25%
164D	102101516.IB	21 鲁能源 MTN004	AAA	2.36%
164D	102101516.IB	21 鲁能源 MTN004	AAA	2.36%
167D	101901077.IB	19 中铝集 MTN005	AAA	2.33%
167D	101901077.IB	19 中铝集 MTN005	AAA	2.33%
167D	101901077.IB	19 中铝集 MTN005	AAA	2.33%
167D	101901077.IB	19 中铝集 MTN005	AAA	2.33%
167D	101901077.IB	19 中铝集 MTN005	AAA	2.33%
182D	102100557.IB	21 宝城投 MTN001	AA/AAA	2.55%
182D	102100557.IB	21 宝城投 MTN001	AA/AAA	2.55%
199D(休 2)	101901249.IB	19 北排水 MTN001	AAA	2.30%
211D(休 2)	102101978.IB	21 昆明高速 MTN002	AA+	2.85%
211D(休 2)	102101975.IB	21 南航股 MTN002	AAA	2.3125%
211D(休 2)	102101975.IB	21 南航股 MTN002	AAA	2.3125%
248D	102102246.IB	21 晋江城投 MTN003	AA+	2.39%
264D	101901578.IB	19 津城建 MTN011B	AAA	2.41%
277D	102103171.IB	21 滁州同创 MTN003	AA+	2.48%
322D	102000074.IB	20 吉安城建 MTN001	AA+/AA	2.56%
332D	102280221.IB	22 淮北建投 MTN002	AA+	2.51%
358D+2Y	102280308.IB	22 金融街 MTN001	AAA	2.48%
1.02Y(休 1)	102000279.IB	20 南电 MTN005	AAA	2.27%
1.04Y+1Y	102380499.IB	23 武汉国创 MTN001(科创票据)	AA+/AAA	2.56%
1.05Y	102280557.IB	22 萧山交投 MTN001	AA+/AAA	2.45%
1.07Y	102000478.IB	20 萧山国资 MTN001	AAA	2.39%
1.07Y	102000478.IB	20 萧山国资 MTN001	AAA	2.39%
1.07Y	102000478.IB	20 萧山国资 MTN001	AAA	2.39%
1.14Y(休 1)	102000729.IB	20 东莞交投 MTN001	AAA	2.40%
1.14Y	102000778.IB	20 芜湖建设 MTN003	AAA	2.45%
1.5Y	102282010.IB	22 中电国际 MTN004	AAA	2.40%
1.5Y	102282010.IB	22 中电国际 MTN004	AAA	2.40%
1.58Y(休 1)	102282171.IB	22 龙控 MTN002	AA	2.85%
1.66Y	102282389.IB	22 鄂联投 MTN004	AAA	2.64%
1.88Y(休 1)	102100080.IB	21 上虞城建 MTN001	AA+	2.62%
1.89Y	102100104.IB	21 德清建设 MTN001	AA+	2.63%
2.3Y+NY	102381455.IB	23 淮河能源 MTN003	AAA	2.70%
2.54Y	102382482.IB	23 鄂联投 MTN004	AAA	2.82%
2.71Y+NY	102383058.IB	23 中电国际 MTN002	AAA	2.67%
2.72Y+NY	102383076.IB	23 中建七局 MTN002(科创票据)	AAA	2.88%
2.87Y	102480111.IB	24 晋能煤业 MTN001	AAA	2.71%
2.88Y	102400597.IB	24 冀中能源 MTN002B(科创票据)	AAA	3.40%

3Y(休 1)	102480594.IB	24 南电 MTN001	AAA	2.42%
4.93Y	102480406.IB	24 广州地铁 MTN002	AAA	2.70%
5.98Y	102000132.IB	20 鄂联投(疫情防控 债)MTN001	AAA	3.50%
9.54Y	102382460.IB	23 济南城建 MTN003	AAA	3.11%
19.31Y(休 1)	102381487.IB	23 国新控股 MTN001B	AAA	2.90%

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
28D+2Y(休 1)	175907.SH	21 首置 03	AAA	100.6
28D+2Y(休 1)	175907.SH	21 首置 03	AAA	100.6
28D+2Y(休 1)	175907.SH	21 首置 03	AAA	100.6
28D+2Y(休 1)	175907.SH	21 首置 03	AAA	100.6
41D	115186.SH	23 安信 S2	AAA/A-1	2.18%
52D	188020.SH	21 南资 02	AA+	2.50%
53D+NY	155939.SH	19 电投 Y6	AAA	2.35%
59D+2Y	188039.SH	21 宁德 01	AA	2.34%
59D+2Y	188041.SH	21 武经 01	AA+	2.30%
60D	188091.SH	21 扬州 01	AAA	2.34%
64D(休 2)	250936.SH	23 宣控 D1	AA+	2.49%
66D	155408.SH	19 无锡 05	AA+	2.35%
72D(休 1)	188098.SH	21 苏信 01	AAA	2.35%
72D(休 1)	188098.SH	21 苏信 01	AAA	2.35%
84D	188134.SH	21 华泰 G5	AAA	2.20%
84D	188134.SH	21 华泰 G5	AAA	2.20%
99D(休 3)	149499.SZ	21 广发 03	AAA	2.27%
99D(休 3)	149499.SZ	21 广发 03	AAA	2.27%
106D(休 2)	188229.SH	21 安信 G3	AAA	2.20%
106D(休 2)	188239.SH	21 华泰 G7	AAA	2.19%
106D(休 2)	188239.SH	21 华泰 G7	AAA	2.19%
113D(休 2)	148514.SZ	23 申证 D1	AAA/A-1	2.23%
113D(休 2)	148514.SZ	23 申证 D1	AAA/A-1	2.23%
145D	155556.SH	19 津投 20	AAA	2.45%
157D+6Y(休 1)	149581.SZ	21 青城 07	AAA	2.39%
157D	182368.SH	22 伊资 02	AA	2.80%
178D	149614.SZ	21 申证 10	AAA	2.24%
192D+2Y	188709.SH	21 高科 03	AA+	2.40%
201D	115964.SH	23 中 S10	AAA/A-1	2.25%
230D	188736.SH	21 国君 12	AAA	2.25%
232D(休 2)	188871.SH	21 平证 11	AAA	2.29%
232D(休 2)	188871.SH	21 平证 11	AAA	2.29%
276D+2Y	133146.SZ	21 宣经 02	AA/AAA	2.55%
318D	162886.SH	20 迈瑞 01	AA+	2.76%
332D+2Y	196336.SH	22 实创 01	AA+	2.55%
1Y(休 1)	185446.SH	22 唐新 01	AAA	2.36%
1.02Y(休 1)	163255.SH	20 建材 01	AAA	2.34%
1.03Y	149835.SZ	22 天马 02	AAA	2.46%
1.04Y(休 2)	092280004.IB	22 东方债 01BC	AAA	2.40%
1.04Y(休 2)	092280004.IB	22 东方债 01BC	AAA	2.41%
1.05Y+2Y(休 1)	185569.SH	22 中铁 01	AAA	2.50%
1.05Y+2Y(休 1)	185569.SH	22 中铁 01	AAA	2.50%
1.05Y+2Y(休 1)	185569.SH	22 中铁 01	AAA	2.50%
1.06Y+5Y(休 2)	2023001.IB	20 人民财险	AAA	2.40%
1.17Y(休 3)	127812.SH	PR 万盛 02	AA/AAA	2.61%
1.19Y+NY(休 1)	185740.SH	G22HXY1	AAA	2.47%
1.69Y(休 1)	114116.SH	22 任丘 02	AA/AA+	3.05%
1.75Y+NY(休 1)	138616.SH	22 电 YK01	AAA	2.47%
1.76Y	177275.SH	20 沧州 01	AA+	2.70%
2.02Y	178032.SH	21 中财 C2	AAA	2.63%
2.06Y	250276.SH	23 柯岩 01	AA	2.85%
2.15Y(休 1)	188048.SH	21 渝水 01	AAA	2.53%
2.3Y	115703.SH	23 招证 G8	AAA	2.46%
2.3Y	115703.SH	23 招证 G8	AAA	2.46%
2.39Y+2Y	251754.SH	23 安建 01	AA+	3.00%
2.39Y+NY	148387.SZ	23 鞍钢 KY04	AAA	2.69%
2.39Y+NY	148387.SZ	23 鞍钢 KY04	AAA	2.69%
2.7Y	2322015.IB	23 光大租赁债	AAA	2.53%
2.7Y	262380002.IB	23 交银金租绿债 01	AAA	2.53%
2.71Y(休 2)	1680454.IB	16 贵阳停车场债 02	AAA/AA+	3.18%
2.82Y+2Y	2380144.IB	23 汴微 02	AA+	3.06%
2.82Y+2Y	148560.SZ	23 长轨 G4	AAA	2.61%

2.88Y	262480001.IB	24 江苏金租绿债 01	AAA	2.62%
2.88Y	262480001.IB	24 江苏金租绿债 01	AAA	2.61%
2.89Y	253526.SH	24 鲁公 01	AA+	3.50%
2.9Y+6Y(休 1)	253753.SH	24 知投 01	AAA	2.81%
2.9Y+6Y(休 1)	253753.SH	24 知投 01	AAA	2.81%
2.91Y	253746.SH	24 新彭 01	AA	3.00%
2.92Y(休 1)	253793.SH	24 武义 01	AA+	2.80%
2.92Y	148597.SZ	24 长江 01	AAA	2.63%
2.93Y	252480002.IB	24 交银金租债 01	AAA	2.59%
2.98Y	240601.SH	24 石资 K1	AAA	2.59%
2.99Y	185422.SH	22 东吴 02	AAA	2.56%
3.12Y	091701003.IB	17 中国信达债 03	AAA	2.72%
3.35Y+NY	149974.SZ	22 国信 Y2	AAA	2.70%
3.35Y+NY	149974.SZ	22 国信 Y2	AAA	2.70%
4.52Y+5Y	272380011.IB	23 人寿再保险资本补充债 01	AAA	2.80%
4.52Y+5Y	272380011.IB	23 人寿再保险资本补充债 01	AAA	2.80%
5Y	1980056.IB	19 首旅债 02	AAA	2.79%
144D	032100786.IB	21 洛阳城投 PPN004	AA+	2.49%
265D	031900849.IB	19 沪地产 PPN001	AAA	2.47%
277D+3Y	032191377.IB	21 成都高新 PPN001	AAA	2.40%
1.43Y	032280686.IB	22 历下控股 PPN002	AA+	2.63%
1.85Y	032100005.IB	21 南昌水投 PPN001	AAA	2.65%
2.5Y(休 1)	032380812.IB	23 常城建 PPN003	AAA	2.65%
2.5Y(休 1)	032380812.IB	23 常城建 PPN003	AAA	2.65%
2.87Y+2Y	032480038.IB	24 人居地产 PPN001	AA	2.92%
15D(休 2)	2120010.IB	21 厦门国际银行小微债 01	AAA	2.25%
18D+5Y	1928004.IB	19 农业银行二级 02	AAA	2.13%
23D(休 1)	2128010.IB	21 光大银行小微债	AAA	2.00%
24D	2128012.IB	21 浦发银行 01	AAA	1.85%
24D	2128012.IB	21 浦发银行 01	AAA	1.85%
38D	2128013.IB	21 交通银行小微债	AAA	2.09%
38D	2128013.IB	21 交通银行小微债	AAA	2.09%
38D	2128013.IB	21 交通银行小微债	AAA	2.09%
41D+5Y	1928009.IB	19 农业银行二级 04	AAA	2.30%
42D	2120026.IB	21 江苏银行双创债	AAA	2.13%
59D+5Y(休 1)	1928010.IB	19 平安银行二级	AAA	2.33%
90D+5Y	1920039.IB	19 杭州银行二级	AAA	2.35%
90D+5Y	1920039.IB	19 杭州银行二级	AAA	2.35%
133D+5Y	1920046.IB	19 宁波银行二级	AAA	2.35%
151D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.35%
171D+5Y(休 2)	1428011.IB	14 建行二级 01	AAA	2.33%
171D+5Y(休 2)	1428011.IB	14 建行二级 01	AAA	2.33%
171D+5Y(休 2)	1428011.IB	14 建行二级 01	AAA	2.33%
172D+NY	1928021.IB	19 农业银行永续债 01	AAA	2.35%
178D	2128027.IB	21 招商银行小微债 03	AAA	2.18%
179D+5Y	1928022.IB	19 兴业银行二级 01	AAA	2.34%
179D	2120073.IB	21 广州银行小微债 02	AAA	2.25%
179D+5Y	1928022.IB	19 兴业银行二级 01	AAA	2.335%
203D+NY	1928025.IB	19 交通银行永续债	AAA	2.37%
203D+NY	1928025.IB	19 交通银行永续债	AAA	2.36%
354D	2220010.IB	22 宁波银行 01	AAA	2.27%
357D	2228009.IB	22 光大银行小微债	AAA	2.27%
357D	2228009.IB	22 光大银行小微债	AAA	2.27%
357D	2228009.IB	22 光大银行小微债	AAA	2.25%
361D+NY	2028003.IB	20 平安银行永续债 01	AAA	2.465%
1.04Y	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	2.24%
1.05Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.42%
1.05Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.42%
1.05Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.42%
1.05Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.42%
1.05Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.42%
1.05Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.42%
1.05Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.42%
1.05Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.42%
1.08Y+NY	2020016.IB	20 江苏银行永续债	AAA	2.48%
1.14Y+5Y(休 2)	2020022.IB	20 南京银行二级 01	AAA	2.40%
1.18Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.38%
1.18Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.38%
1.18Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.38%
1.18Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.38%
1.2Y+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.425%
1.2Y+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.415%

1.2Y+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.40%
1.22Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.38%
1.22Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.38%
1.23Y(休 1)	2228032.IB	22 建设银行绿色金融债 01	AAA	2.26%
1.23Y(休 1)	2228032.IB	22 建设银行绿色金融债 01	AAA	2.26%
1.31Y(休 2)	2228043.IB	22 中国银行小微债 01	AAA	2.27%
1.31Y(休 2)	2228043.IB	22 中国银行小微债 01	AAA	2.27%
1.31Y(休 2)	2228043.IB	22 中国银行小微债 01	AAA	2.27%
1.31Y(休 2)	2228043.IB	22 中国银行小微债 01	AAA	2.27%
1.33Y+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.58%
1.33Y+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.58%
1.36Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.44%
1.36Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.44%
1.36Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.45%
1.36Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.45%
1.36Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.45%
1.36Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.45%
1.36Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.45%
1.43Y	2228046.IB	22 中信银行 02	AAA	2.29%
1.43Y	2228046.IB	22 中信银行 02	AAA	2.28%
1.43Y	2228046.IB	22 中信银行 02	AAA	2.28%
1.48Y+NY(休 1)	2028032.IB	20 农业银行永续债 02	AAA	2.45%
1.48Y+NY(休 1)	2028032.IB	20 农业银行永续债 02	AAA	2.45%
1.54Y+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.415%
1.54Y+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.41%
1.56Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.47%
1.56Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.46%
1.56Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.46%
1.56Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.47%
1.56Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.47%
1.56Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.47%
1.56Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.47%
1.56Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.46%
1.57Y+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.47%
1.57Y+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.47%
1.62Y+NY	2028042.IB	20 兴业银行永续债	AAA	2.48%
1.62Y+NY	2028042.IB	20 兴业银行永续债	AAA	2.48%
1.72Y+NY	2028048.IB	20 中国银行永续债 02	AAA	2.48%
1.73Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.485%
1.73Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.47%
2.06Y+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	2.52%
2.12Y	2320014.IB	23 苏州银行绿色债	AAA	2.40%
2.14Y+NY	2128016.IB	21 民生银行永续债 01	AAA	2.82%
2.14Y+NY	2128016.IB	21 民生银行永续债 01	AAA	2.82%
2.14Y+NY	2128016.IB	21 民生银行永续债 01	AAA	2.82%
2.22Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	2.53%
2.27Y+5Y(休 2)	2120047.IB	21 宁波银行二级 01	AAA	2.52%
2.28Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.51%
2.4Y	212380011.IB	23 上海银行债 02	AAA	2.40%
2.4Y(休 2)	212380009.IB	23 长沙银行债 01	AAA	2.43%
2.4Y(休 2)	212380009.IB	23 长沙银行债 01	AAA	2.43%
2.44Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.48%
2.48Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.475%
2.48Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.475%
2.48Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.47%
2.48Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.48%
2.53Y	2321029.IB	23 东莞农商小微债 01	AAA	2.43%
2.58Y+5Y(休 2)	2128030.IB	21 交通银行二级	AAA	2.50%
2.66Y	212380022.IB	23 华夏银行债 04	AAA	2.40%
2.69Y+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	2.53%
2.69Y+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	2.53%
2.69Y	212380023.IB	23 光大银行债 03	AAA	2.40%
2.71Y+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	2.53%
2.71Y+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	2.51%
2.71Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	2.57%
2.71Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	2.56%
2.71Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	2.56%
2.71Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	2.57%
2.74Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.70%
2.74Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.67%
2.74Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.67%
2.74Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.66%

2.75Y+NY(休 1)	2128045.IB	21 中国银行永续债 02	AAA	2.59%
2.75Y+NY(休 1)	2128045.IB	21 中国银行永续债 02	AAA	2.59%
2.79Y+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	2.65%
2.79Y+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	2.50%
2.79Y+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	2.51%
2.82Y+5Y(休 2)	2121062.IB	21 北京农商二级	AAA	2.62%
2.88Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	2.59%
2.89Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	2.51%
2.91Y	2420002.IB	24 北部湾银行小微债 01	AAA	2.66%
2.98Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.62%
3.11Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	2.63%
3.11Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	2.61%
3.16Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	AAA	2.63%
3.16Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	AAA	2.61%
3.3Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.58%
3.3Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.58%
3.3Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.54%
3.35Y+5Y	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	AAA	2.62%
3.35Y+5Y	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	AAA	2.62%
3.65Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	2.60%
3.69Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.61%
3.69Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.62%
3.83Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.76%
3.83Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.75%
4.06Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	2.635%
4.08Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.93%
4.29Y+NY	242380008.IB	23 中行永续债 01	AAA	2.68%
4.5Y+5Y	232380034.IB	23 厦门国际二级资本债 02	AAA	2.93%
4.5Y+5Y	232380034.IB	23 厦门国际二级资本债 02	AAA	2.93%
4.5Y+5Y	232380034.IB	23 厦门国际二级资本债 02	AAA	2.93%
4.54Y+5Y	232380052.IB	23 农行二级资本债 02A	AAA	2.655%
4.56Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	2.63%
4.65Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	2.655%
4.65Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	2.655%
4.65Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	2.655%
4.65Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	2.635%
4.67Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA	2.655%
4.71Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	2.65%
4.74Y+5Y(休 1)	232380082.IB	23 浙商银行二级资本债 02	AAA	2.795%
4.8Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	2.70%
4.92Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	2.65%
4.92Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	2.65%
4.92Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	2.635%
4.93Y+5Y(休 1)	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A	AAA	2.655%
4.93Y+5Y(休 1)	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A	AAA	2.65%
4.93Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.88%
4.93Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.88%
4.93Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.88%
4.93Y+5Y(休 1)	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A	AAA	2.63%
4.93Y+5Y(休 1)	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A	AAA	2.63%
4.94Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.655%
4.94Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.655%
4.94Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.655%
4.94Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.655%
4.94Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.65%
4.94Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.65%
4.94Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.63%
4.94Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.63%