

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

【2026-04-08】

国债

今日央行开展 5 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 5 亿，逆回购口径资金零投放零回笼。

国债方面 1.91Y 250005 1.25-1.25； 3.82Y 250003 1.4425-1.45； 5.99Y 250007 1.595-1.60； 9.41Y 250016 1.814-1.823； 29.41Y 2500006 2.304-2.324。

	1y	3y	5y	7y	10y	30y
昨日国债(%)	1.1700	1.2700	1.5200	1.6460	1.8190	2.3145
今日国债(%)	1.1700	1.2700	1.5300	1.6450	1.8150	2.3070
变动(%)	0.0000	0.0000	0.0100	-0.0010	-0.0040	-0.0075

金融债

金融债方面 295D 260401 1.413-1.419； 2.90Y 240203 1.5525-1.5625； 5.80Y 220205 1.705-1.71； 9.22Y 250215 1.885-1.8975。

	1y	3y	5y	7y	10y
昨日非国开金融债(%)	1.3650	1.5275	1.6100	1.7825	1.8900
今日非国开金融债(%)	1.3675	1.5400	1.6275	1.7800	1.8875
变动(%)	0.0025	0.0125	0.0175	-0.0025	-0.0025
昨日国开债(%)	1.4050	1.5750	1.6275	1.7640	1.8990
今日国开债(%)	1.4175	1.5950	1.6400	1.7630	1.8865
变动(%)	0.0125	0.0200	0.0125	-0.0010	-0.0125

银行债

5y 大行二级全天交易十分活跃，买盘情绪较为火热，盘中收益率开盘后迅速上升，后全天持续下行。非免税券昨收 1.97 (-0.86)，今开 1.975 (-0.36)。日内最高 1.9825 (+0.39)，最低 1.975 (-0.36)，震荡区间 0.75bp，今收 1.9775 (-0.11)，尾盘对峙为 1.9775/1.97。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 1.87 (-0.5)，今开 1.88(+0.5)，日内最高 1.88 (+0.5)，最低 1.87 (-0.5)，今收 1.88 (+0.5)，尾盘对峙为 1.88/1.8775，市场成交依旧火热；

十年 25 农行二级资本债 03B(BC) 昨收 2.355 (-0.09)，今开 2.35(-0.59)，最高 2.35(-0.59)，最低 2.34(-1.59)，今收 2.34(-1.59)，尾盘对峙为 2.335/2.33；5y 股份制二永收益下行。4.64y 25 平安银行永续债 01 成交在 2.11 (-0.49) 到 2.115 (+0.01)，震荡区间 0.5bp。今日股份制二永成交情绪一般，主要是基金，理财，券商参与。

1-3y 大行二级今日成交收益率盘内持续震荡，整体上行，其中 1y 附近大行二级较昨日上行近 1bp；1y 大行今开 1.54/1.53，最高成交在 1.545 (+0.70)，最低成交在 1.54 (+0.20)，尾盘收在 1.545/1.54。2y 大行今开 1.62/1.615，成交在 1.62 (+0.99) 和 1.6175 (+0.74)，尾盘收在 1.62/1.615。今日 1-3y 大行二级交易情绪较平稳，买卖盘力量均衡，基金、券商、银行与理财均有参与。

商金方面，1-3y 大行主要成在 (-1) 到 (+1)。1.47y 24 交行债 02BC 成在 1.535 (+0.7)。股份制主要成在 (-1) 到 (+0.5)。1.26y 24 中信银行债 01 成在 1.52 (-0.06)。大城商行今日主要成在 (-3) 到 (+2)。1.87y 25 北京银行小微债 01 成在 1.575 (-0.89) 到 1.58 (-0.39)。科创今日主要成在 (-0.5) 到估值 (+0)。2.1y 25 兴业银行科创债 01 成在 1.565 (-0.25)。收益率全天持续动荡，尾盘后走低。基金、银行/基金、银行、证券为主。

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，37D 012680504.IB 26 大唐集 SCP003 AAA 成交在 1.53% (-0.15)，基金出给银行；86D 012680430.IB 26 蒙牛 SCP009 AAA 成交在 1.55% (+0.36)，基金出给基金。中长端方面，139D 012680633.IB 26 国能新能 SCP001 AAA 成交在 1.55% (-0.9)，基金出给基金；114D 012680669.IB 26 大唐发电 SCP003 AAA 成交在 1.54% (-0.21)，基金出给基金。长端方面，353D 072610055.IB 26 东财证券 CP002 AAA 成交在 1.59% (-1.04)，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-2左右。汇金、电网今日成交活跃度一般，5y 汇金今日在 1.79% (+0.05) 成交。10Y 电网无成交
1-3Y，好名字整体成交在估值-2 到估值，1.57Y 22 国新控股 MTN005(能源保供特别债)成在 1.625% (-0.29)，1.31Y 24 中建材 MTN001 成在 1.61% (-0.67)，1.02Y 24 核能电力 MTN001A 成在 1.56% (-0.05)。成交收益率集中在 1.55%-2.00%，银行出给基金。
3-5Y，好名字整体成交在估值-2 到估值+1，4.9Y 26 广州产投 MTN001(科创债)成在 1.91% (-0.04)，3.2Y 24 科学城 MTN001 成在 2.32% (-1.00)，4.94Y 26 粤环保 MTN001 成在 1.89% (+3)，收益率集中在 1.80%-2.30%，银行出给基金、保险。
5Y+，18.55Y 24 川能投 MTN008 成在 2.78% (+0.06)；27.95Y 24 诚通控股 MTN009B 成在 2.80% (-0.40)，成交收益率主要集中在 2.20%-2.50%。
永续中票集中在 3Y、5Y 附近的好名字，成交收益率大概在估值-3 到估值+1，基金出给券商。

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，银行均有参与，基金理财为主。全天收益小幅下行。
1年内，券商债成交在估值到估值-4 (337D 22 中证 04(免) 1.49)，基金理财买，基金券商资管卖；非券商债多成交在 1.48-1.6，(242D 23 深投 07 1.56)，基金理财保险买，基金保险券商卖；年内科创债今日成交尚可 (139D 25 管网 SK 1.49)。
1-3年，今日券商债成交较为活跃，成交多在估值到估值-2 (2.84Y 26 华泰 G1 1.70)，基金理财买，基金保险卖；非券商债成交尚可，多成交在估值-1 附近 (2.04Y 25 皖交 01 1.65)，基金券商买，券商银行基金卖。科创债成交尚可 (2.98Y 26 电投 K3 1.705)。
3-5年，券商债今日成交寥寥；非券商债方面今日成交尚可，成交多在估值-2.5 到估值 (4.19Y 25 津投 03 2.09)，基金券商及理财双边参与，券商资管买，银行卖；科创方面今日成交寥寥，成交在估值-2 到估值+1 (4.96Y 26CHNG3K 1.83)，基金券商双边参与，券商资管买，银行卖。
5Y+，券商债成交寥寥；非券商债成交非常活跃，成交多在估值-1 到估值-2 之间 (8.37Y 24 中化 12 2.38)，基金和券商双边参与买卖盘；科创方面亦成交非常活跃，多成交在估值-1 附近 (9.62Y 25 诚通 K1 2.24)，基金双边参与买卖盘。

美元债

周三市场情绪明显好转。城投板块，1-2Y 投资级美元城投供需两旺，高评级主体受到投资者欢迎，好名字点心债依旧维持单边买盘。地产板块，万科上涨 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 (%)
8D	012680152.IB	26 中油股 SCP001(科创债)	AAA	1.42
56D	012582977.IB	25 华能新能 SCP006	AAA	1.46
78D	012680852.IB	26 伊利实业 SCP006	AAA	1.45
85D	012680864.IB	26 招商公路 SCP002	AAA	100.00 净价
93D	012680086.IB	26 远东租赁 SCP001	AAA	1.65
93D	012680086.IB	26 远东租赁 SCP001	AAA	1.65
93D	012680086.IB	26 远东租赁 SCP001	AAA	1.65
93D	012680086.IB	26 远东租赁 SCP001	AAA	1.65
114D	012582699.IB	25 京能洁能 SCP006(科创债)	AAA	1.48
114D	012582699.IB	25 京能洁能 SCP006(科创债)	AAA	1.48
134D	012680736.IB	26 中电投 SCP002	AAA	1.48
135D	072610012.IB	26 中信建投 CP003	AAA	1.475
163D	012583148.IB	25 济南建工 SCP002	AA+	2.25
163D	012583148.IB	25 济南建工 SCP002	AA+	2.25
163D	042580496.IB	25 国航 CP001	AAA	1.48
169D	012680885.IB	26 象屿 SCP004	AAA	100.00 净价
173D	012680144.IB	26 瀚蓝 SCP001	AAA	1.52
185D(休 2)	012680820.IB	26 济南城建 SCP002	AAA	1.55
292D	042680050.IB	26 湘高速 CP001	AAA	1.53
342D	042680096.IB	26 湘高速 CP002	AAA	1.53
342D	042680096.IB	26 湘高速 CP002	AAA	1.53

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 (%)
13D	101653019.IB	16 华能集 MTN003	AAA	1.47
13D	101653019.IB	16 华能集 MTN003	AAA	1.47
19D	102381109.IB	23 招金 MTN002(科创票据)	AAA	1.5
34D	102100962.IB	21 川铁投 MTN005	AAA	1.5
34D	102100962.IB	21 川铁投 MTN005	AAA	1.5
34D	102100962.IB	21 川铁投 MTN005	AAA	1.5
104D	102381753.IB	23 郑州交通 MTN002	AA+	1.55

235D(休 1)	102383211.IB	23 电投融和 MTN001(碳中和)	AAA	1.58
271D	102480014.IB	24 常城建 MTN001	AAA	1.54
278D	102280055.IB	22 青岛海创 MTN001	AA+	1.82
322D	102580755.IB	25 津城建 MTN001	AAA	1.58
351D	102280634.IB	22 淮南建发 MTN002	AA+	1.63
353D(休 2)	102481187.IB	24 南航股 MTN001	AAA	1.58
363D	102680019.IB	26 远东租赁 MTN001	AAA	1.76
1.03Y	102481616.IB	24 闽冶金 MTN002	AAA	1.57
1.03Y	102481616.IB	24 闽冶金 MTN002	AAA	1.57
1.03Y	102280832.IB	22 华电股 MTN002B	AAA	1.555
1.05Y	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA	1.535
1.06Y	102481867.IB	24 中电投 MTN004	AAA	1.56
1.19Y	102281315.IB	22 铁建房产 MTN001	AAA	2.3
1.19Y	102281315.IB	22 铁建房产 MTN001	AAA	2.3
1.19Y	102582504.IB	25 晋交投 MTN004	AA+	1.63
1.26Y(休 1)	102482947.IB	24 华电股 MTN003	AAA	1.59
1.26Y	102482938.IB	24 深圳环水 MTN001A	AAA	1.63
1.26Y	102482938.IB	24 深圳环水 MTN001A	AAA	1.63
1.27Y	102483034.IB	24 湖南能源 MTN005A	AAA	1.63
1.29Y(休 2)	102483150.IB	24 义乌国资 MTN004	AAA	1.61
1.35Y(休 1)	102483525.IB	24 华电股 MTN005	AAA	1.595
1.52Y(休 2)	102484403.IB	24 宣城国控 MTN002	AA+	1.655
1.53Y+NY	102501652.IB	25 鲁钢铁 MTN014	AAA	1.91 行权
1.6Y+2Y	102401036.IB	24 首开 MTN007B	AAA	3.76 行权
1.6Y+2Y	102401036.IB	24 首开 MTN007B	AAA	3.76 行权
1.61Y	102584767.IB	25 陕建集团 MTN013(科创债)	AAA	3.48
1.63Y+2Y	102485121.IB	24 漳州资本 MTN003	AA+	1.79 行权
1.63Y+2Y	102485121.IB	24 漳州资本 MTN003	AA+	1.79 行权
1.66Y+NY(休 2)	102485259.IB	24 洛阳城投 MTN003	AA+	1.94 行权
1.66Y+2Y	102585109.IB	25 粤财投资 MTN003	AAA	1.685 行权
1.67Y+NY(休 2)	102585199.IB	25 中化股 MTN008	AAA	1.7 行权
1.69Y	102485419.IB	24 中色 MTN007	AAA	1.66
1.71Y+2Y	102485557.IB	24 北京公交 MTN001	AAA	1.70 行权
1.75Y(休 2)	102580065.IB	25 广西能源 MTN001A	AAA	1.725
1.77Y	102680150.IB	26 平安租赁 MTN002	AAA	1.87
1.79Y(休 2)	102680270.IB	26 京科技园 MTN001	AA+	2.6
1.85Y	102580558.IB	25 龙岩投资 MTN001	AA	1.81
1.9Y	102300295.IB	23 临沂城发 MTN001	AA+	1.75
2.05Y+NY	102581888.IB	25 开滦 MTN003	AAA	2.04 行权
2.14Y(休 2)	102582187.IB	25 上海城开 MTN001	AA+	1.86
2.14Y(休 2)	102582188.IB	25 中交集 MTN001	AAA	1.68
2.14Y(休 2)	102582188.IB	25 中交集 MTN001	AAA	1.68
2.16Y	102582267.IB	25 汇金 MTN004	AAA	1.66
2.16Y	102582294.IB	25 华润控股 MTN003A	AAA	2.03
2.18Y	102582361.IB	25 巴斯夫 MTN001A(BC)	AAA	1.78
2.18Y	102582361.IB	25 巴斯夫 MTN001A(BC)	AAA	1.78
2.18Y	102582361.IB	25 巴斯夫 MTN001A(BC)	AAA	1.78
2.18Y	102582361.IB	25 巴斯夫 MTN001A(BC)	AAA	1.78
2.18Y	102582361.IB	25 巴斯夫 MTN001A(BC)	AAA	1.78
2.18Y	102582361.IB	25 巴斯夫 MTN001A(BC)	AAA	1.785
2.19Y(休 1)	102582419.IB	25 皖投集 MTN002	AAA	1.73
2.19Y(休 1)	102582419.IB	25 皖投集 MTN002	AAA	1.73
2.19Y(休 1)	102582419.IB	25 皖投集 MTN002	AAA	1.73
2.21Y(休 1)	102582553.IB	25 中石集 MTN002	AAA	1.66
2.23Y	102582674.IB	25 青岛上合 MTN002	AAA	2.1

2.23Y	102582674.IB	25 青岛上合 MTN002	AAA	2.1
2.31Y(休 2)	102583121.IB	25 浙交投 MTN004	AAA	1.69
2.31Y(休 2)	102583133.IB	25 淮北建投 MTN008	AA+	1.88
2.33Y(休 1)	102583238.IB	25 湘建工 MTN002(科创债)	AAA	2.09
2.33Y(休 1)	102583238.IB	25 湘建工 MTN002(科创债)	AAA	2.09
2.34Y	102583337.IB	25 黄河路桥 MTN002	AA+	2.04
2.34Y	102583337.IB	25 黄河路桥 MTN002	AA+	2.04
2.42Y(休 1)	102583810.IB	25 商丘发展 MTN002	AA+	1.94
2.44Y(休 1)	102583921.IB	25 雅安 MTN001A	AA	1.91
2.47Y	102584159.IB	25 中交建 MTN001	AAA	1.705
2.6Y	102584725.IB	25 华润 MTN007A	AAA	1.71
2.6Y	102584730.IB	25 特变 MTN001	AA+	2.08
2.63Y(休 2)	102584944.IB	25 东航股 MTN005	AAA	1.73
2.63Y(休 2)	102584944.IB	25 东航股 MTN005	AAA	1.73
2.81Y(休 2)	102680318.IB	26 安徽路港 MTN001(科创债)	AA+	2.59
2.81Y	102480355.IB	24 福清国资 MTN001	AA+	1.79
2.82Y+2Y	102680417.IB	26 中国平煤 MTN003	AAA	2.38 行权
2.91Y	102400647.IB	24 湖北科技 MTN003	AAA	1.81
2.93Y	102680813.IB	26 淮南建发 MTN001	AA+	1.88
2.94Y(休 1)	102680895.IB	26 中原高速 MTN002(绿色)	AAA	1.8
2.94Y(休 1)	102680898.IB	26 中原高速 MTN003	AAA	1.8
2.94Y(休 1)	102680931.IB	26 京国资 MTN003	AAA	1.72
2.96Y+NY	102681102.IB	26 福建漳州 MTN001	AAA	1.995 行权
2.96Y	132680031.IB	26 万华化学 GN005(科创债)	AAA	1.77
2.96Y	132680031.IB	26 万华化学 GN005(科创债)	AAA	1.77
2.96Y	132680031.IB	26 万华化学 GN005(科创债)	AAA	1.77
2.96Y	132680031.IB	26 万华化学 GN005(科创债)	AAA	1.77
2.96Y	132680031.IB	26 万华化学 GN005(科创债)	AAA	1.77
2.97Y	102481193.IB	24 太湖新城 MTN002	AAA	1.78
2.97Y	102681172.IB	26 中建五局 MTN001	AAA	1.8
2.97Y	102681172.IB	26 中建五局 MTN001	AAA	1.8
2.98Y+2Y(休 1)	102681185.IB	26 平湖国发 MTN001	AAA	1.80 行权
2.99Y	102681241.IB	26 海发国资 MTN002	AAA	1.945
3Y(休 1)	102681265.IB	26 广州地铁 MTN005	AAA	1.73
3Y(休 1)	102681265.IB	26 广州地铁 MTN005	AAA	1.73
3Y(休 1)	102681265.IB	26 广州地铁 MTN005	AAA	1.73
3Y(休 1)	102681265.IB	26 广州地铁 MTN005	AAA	1.73
3Y(休 1)	102681265.IB	26 广州地铁 MTN005	AAA	1.73
3Y(休 1)	102681265.IB	26 广州地铁 MTN005	AAA	1.73
3.2Y+NY	102482382.IB	24 宁河西 MTN003	AAA	1.96 行权
3.23Y	102482821.IB	24 招商公路 MTN001	AAA	1.75
3.28Y	102483081.IB	24 中燃投资 MTN003	AAA	1.95
3.28Y	102483082.IB	24 中建投资 MTN002	AAA	1.92
3.35Y	102483498.IB	24 山东金融 MTN001	AAA	1.905
3.39Y+NY	102400930.IB	24 河钢集 MTN014	AAA	2.2 行权
3.43Y	102484026.IB	24 苏交通 MTN012	AAA	1.7575
3.43Y	102484026.IB	24 苏交通 MTN012	AAA	1.7575
3.77Y	102580205.IB	25 中石化 MTN001	AAA	1.76
3.78Y	102580316.IB	25 大连城投 MTN001	AA+	2.26
3.96Y	102581339.IB	25 舟山交投 MTN001	AA+	1.98
3.97Y	102581407.IB	25 海宁城投 MTN003B	AA+	1.98
4.21Y(休 1)	102582558.IB	25 盐城资产 MTN002	AAA	1.99
4.22Y	102582641.IB	25 西安高新 MTN011B	AAA	2.55
4.3Y(休 1)	102583092.IB	25 乌高新 MTN002	AA+	2.17
4.3Y(休 1)	102583092.IB	25 乌高新 MTN002	AA+	2.17

4.38Y(休 1)	102583612.IB	25 中海企业 MTN002A	AAA	2.4
4.67Y	102501764.IB	25 新城控股 MTN003	AAA	3.5
4.9Y	102680654.IB	26 广州产投 MTN001(科创债)	AAA	1.91
4.9Y	102680654.IB	26 广州产投 MTN001(科创债)	AAA	1.91
4.93Y	102680827.IB	26 山东公用 MTN002	AA+	2.56
4.94Y	102680882.IB	26 粤环保 MTN001	AAA	1.89
4.95Y	102680938.IB	26 南方水泥 MTN001	AAA	1.97
4.95Y	102680938.IB	26 南方水泥 MTN001	AAA	1.97
4.96Y	102681069.IB	26 临沂城投 MTN001	AAA	2.17
6.35Y	102281771.IB	22 无锡建投 MTN002	AAA	2.05
6.72Y(休 2)	102585356.IB	25 电网 MTN043	AAA	2.01
7.56Y	102382943.IB	23 深圳地铁 MTN006	AAA	2.46
8.21Y(休 2)	102482686.IB	24 晋能装备 MTN003	AAA	2.56
8.21Y(休 2)	102482686.IB	24 晋能装备 MTN003	AAA	2.56
8.98Y	102581460.IB	25 重庆交投 MTN001	AAA	2.335
9.69Y(休 1)	102585259.IB	25 诚通控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.29
9.69Y(休 1)	102585259.IB	25 诚通控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.29
14.28Y	102582940.IB	25 豫交投 MTN002	AAA	2.66
14.28Y	102582940.IB	25 豫交投 MTN002	AAA	2.66
27.95Y	102480956.IB	24 诚通控股 MTN009B	AAA	2.8
27.95Y	102480956.IB	24 诚通控股 MTN009B	AAA	2.8
27.95Y	102480956.IB	24 诚通控股 MTN009B	AAA	2.8

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+2Y	115334.SH	23 诚通 07	AAA	1.50 行权
20D	149424.SZ	21 广铁 02	AAA	1.47
46D(休 1)	188131.SH	21 安信 G2	AAA	1.41
65D	251336.SH	23 冀交 04	AAA	1.54
68D	188228.SH	21 中企 01	AA+	1.63
68D	188228.SH	21 中企 01	AA+	1.63
68D	251419.SH	23 古厝 03	AAA	1.56
77D+NY	149529.SZ	21 申证 Y1	AAA	1.49 行权
110D+2Y	115717.SH	23 吉高 02	AAA	1.55 行权
110D+2Y	115717.SH	23 吉高 02	AAA	1.55 行权
110D	2322008.IB	23 民生租赁货运物流主题债 03	AAA	1.55
111D	149575.SZ	21 申证 09	AAA	1.45
116D(休 1)	136599.SH	16 首旅 02	AAA	1.48
131D	115805.SH	23 首钢 03	AAA	1.51
133D	241473.SH	24 交建 K1	AAA	1.49
139D	243667.SH	25 管网 SK	AAA	1.49
139D	243667.SH	25 管网 SK	AAA	1.49
156D	115936.SH	23 沪开 02	AA+	1.61
158D(休 1)	188730.SH	21 穗建 03	AAA	1.6
222D+NY(休 1)	149700.SZ	21 申证 Y3	AAA	1.52 行权
223D	136819.SH	16 川发 01	AAA	1.52
223D	149703.SZ	21 广发 20	AAA	1.46
223D	149703.SZ	21 广发 20	AAA	1.46
240D	137183.SH	23 潞安 EB	AAA	103.80 净价
256D(休 1)	253391.SH	23 渭控 02	AA+	1.8
264D+NY(休 1)	240445.SH	铁建 YK07	AAA	1.6 行权
293D+NY	185337.SH	22 华泰 Y1	AAA	1.53 行权
296D+NY	240552.SH	鲁高 KY04	AAA	1.6 行权

296D+NY	240552.SH	鲁高 KY04	AAA	1.6 行权
296D+NY	240552.SH	鲁高 KY04	AAA	1.6 行权
304D(休 9)	253872.SH	24 漳交 01	AAA	1.6
333D(休 1)	281810.SH	26 长旅 02	AA	2
333D(休 1)	281810.SH	26 长旅 02	AA	2
341D	253991.SH	24 武经 01	AAA	1.6
344D	134923.SZ	26 古厝 D1	AAA	1.62
352D+2Y	133991.SZ	25 大悦 01	AAA	2.15 行权
356D	184283.SH	22 上饶 01	AAA	1.62
364D	524206.SZ	25 长江 01	AAA	1.51
1.13Y+2Y	241012.SH	24 成渝 01	AAA	1.61 行权
1.17Y(休 1)	185869.SH	22 铁工 04	AAA	1.57
1.17Y+2Y	241102.SH	24 首城 02	AAA	2.05 行权
1.18Y+2Y	254985.SH	24 红投 02	AA+	1.95 行权
1.18Y+2Y	254985.SH	24 红投 02	AA+	1.95 行权
1.19Y	255024.SH	24 霍山 01	AA+	1.67
1.2Y+2Y	241169.SH	24 虞国 01	AA+	1.64 行权
1.29Y	243362.SH	25 国保 02	AAA	1.7
1.29Y	243362.SH	25 国保 02	AAA	1.7
1.43Y+5Y	184567.SH	22 蓉金 02	AAA	1.65 行权
1.46Y	243831.SH	25 浙商 02	AAA	1.63
1.47Y	152599.SH	20 晋江 01	AA+	1.65
1.54Y+6Y(休 1)	148961.SZ	24 粤财 02	AAA	1.65 行权
1.57Y	241875.SH	建材 K9	AAA	1.61
1.62Y+2Y	256536.SH	24 安化 01	AA	1.75 行权
1.69Y	242147.SH	24 国管 04	AAA	1.62
1.72Y	152699.SH	20 泗阳债	AA	1.765
1.75Y+2Y	257057.SH	25 浙城 01	AA+	1.85 行权
1.76Y	524109.SZ	25 深机 01	AAA	1.64
1.76Y	244511.SH	26 中证 G1	AAA	1.63
1.77Y(休 1)	257291.SH	25 潍坊 01	AAA	1.9
1.87Y(休 2)	257458.SH	25 鹰旅 01	AA	2.08
1.87Y(休 1)	032580116.IB	25 江阴城发 PPN001	AA+	1.805
1.88Y	242469.SH	25 株高 G3	AA+	1.9
1.91Y	244679.SH	26 银河 G3	AAA	1.63
1.94Y(休 2)	244874.SH	26 国租 01	AAA	100.00 净价
1.94Y(休 2)	244874.SH	26 国租 01	AAA	100.00 净价
1.97Y	242657.SH	25 中乡 K1	AAA	1.85
1.97Y	242657.SH	25 中乡 K1	AAA	1.85
1.97Y	282204.SH	26 赣建 01	AA+	1.91
2.02Y+2Y	258076.SH	25 泰山 05	AA+	2.24 行权
2.04Y	242887.SH	25 皖交 01	AAA	1.65
2.04Y	242887.SH	25 皖交 01	AAA	1.65
2.04Y	242887.SH	25 皖交 01	AAA	1.67
2.04Y	242887.SH	25 皖交 01	AAA	1.67
2.04Y	242887.SH	25 皖交 01	AAA	1.67
2.06Y+2Y	524258.SZ	25 宝安产发 01	AAA	1.71 行权
2.13Y	243040.SH	GC 核融 08	AAA	1.72
2.23Y(休 2)	241190.SH	24 招证 G3	AAA	1.62
2.24Y	259202.SH	康欣 VZ01	AA	2.07
2.27Y(休 2)	524366.SZ	25 吉电 K1	AAA	1.71
2.28Y+2Y	134365.SZ	25 镇旅 01	AA+	1.93 行权
2.28Y	148383.SZ	23 蛇口 02	AAA	1.92
2.29Y(休 1)	243288.SH	25 投控 02	AAA	100.00 净价
2.3Y+2Y(休 1)	259441.SH	25 长经 03	AA+	1.845 行权

2.41Y	243699.SH	25 吴发 G2	AA+	1.78
2.43Y+2Y	243738.SH	25 吉高 01	AAA	1.80 行权
2.46Y+NY(休 1)	243876.SH	路建 YK10	AAA	1.94 行权
2.46Y+NY(休 1)	243876.SH	路建 YK10	AAA	1.95 行权
2.56Y+NY(休 1)	244014.SH	路建 YK11	AAA	1.96 行权
2.67Y+NY(休 1)	280928.SH	25 国生 Y1	AAA	2.07 行权
2.71Y+2Y	281069.SH	25 新乡 07	AAA	2.02 行权
2.75Y+NY	244508.SH	晋建 YK05	AAA	2.28 行权
2.77Y(休 1)	524623.SZ	26 中海 01	AAA	2.25
2.79Y	281274.SH	26 象开 01	AA	2.03
2.82Y	244640.SH	26 瀚蓝 K1	AAA	1.765
2.83Y(休 1)	244658.SH	26 招证 G2	AAA	1.7025
2.84Y	244692.SH	26 华泰 G1	AAA	1.7
2.94Y(休 2)	282011.SH	26 文汇 01	AA+	1.98
2.96Y	244840.SH	26 铁工 K1	AAA	1.71
2.98Y	244945.SH	26 电投 K3	AAA	1.705
2.98Y	244945.SH	26 电投 K3	AAA	1.705
2.98Y	282225.SH	26 缙资 01	AA	1.99
3Y+NY(休 2)	244981.SH	大唐 YK12	AAA	1.8 行权
3.01Y	254419.SH	24 湾北 01	AA	2.02
3.13Y(休 1)	133849.SZ	24 常投 03	AA+	2.04
3.13Y(休 1)	133849.SZ	24 常投 03	AA+	2.04
3.19Y(休 2)	255047.SH	24 宜发 03	AAA	2
3.26Y	255273.SH	24 岳建 02	AAA	2
3.26Y	255273.SH	24 岳建 02	AAA	2.01
3.38Y(休 1)	255658.SH	24 常投 04	AA+	2.1
3.47Y	148927.SZ	24 格力 03	AAA	2.14
3.5Y+NY	255956.SH	24 济轨 Y4	AAA	2.06 行权
3.59Y+NY(休 1)	148999.SZ	24 蜀道 Y6	AAA	1.89 行权
3.62Y	256510.SH	24 洪产 04	AAA	2.05
3.62Y	256510.SH	24 洪产 04	AAA	2.05
3.62Y	241942.SH	24 华安 C2	AAA	1.91
3.63Y(休 1)	256446.SH	24 渝空 01	AA	2.3
3.76Y	524100.SZ	25 格力 02	AAA	2.17
3.76Y	524100.SZ	25 格力 02	AAA	2.17
3.76Y	524100.SZ	25 格力 02	AAA	2.17
3.97Y	2380072.IB	23 宁国国控专项债 01	AA	2.02
3.98Y(休 1)	258063.SH	25 润新 03	AA	2.46
4.19Y(休 1)	243139.SH	25 津投 03	AAA	2.09
4.2Y	524328.SZ	25 蓉金 01	AAA	1.88
4.59Y	243982.SH	25 华泰 C7	AAA	1.95
4.62Y	244252.SH	25 津投 08	AAA	2.19
4.62Y+5Y	272580008.IB	25 平安产险资本补充债 01	AAA	2.135 行权
4.62Y+5Y	272580008.IB	25 平安产险资本补充债 01	AAA	2.135 行权
4.62Y+5Y	272580008.IB	25 平安产险资本补充债 01	AAA	2.135 行权
4.7Y+5Y	272580010.IB	25 东吴人寿资本补充债 01	AA+	2.39 行权
4.7Y+5Y	272580010.IB	25 东吴人寿资本补充债 01	AA+	2.39 行权
4.7Y+5Y	272580010.IB	25 东吴人寿资本补充债 01	AA+	2.39 行权
4.82Y	134769.SZ	26 产投 K1	2.42	5000
4.82Y	134769.SZ	26 产投 K1	2.42	5000
4.84Y+NY	524669.SZ	26 广发 Y1	AAA	2.155 行权
4.84Y+NY	524669.SZ	26 广发 Y1	AAA	2.155 行权
4.84Y+NY	524669.SZ	26 广发 Y1	AAA	2.155 行权
4.91Y	281831.SH	26 长国 01	AAA	2.4
4.92Y(休 1)	281782.SH	26 长兴 01	AA+	2.35

4.92Y(休 1)	281782.SH	26 长兴 01	AA+	2.35
4.94Y(休 1)	134917.SZ	26 龙城 02	AAA	2.2
4.94Y(休 1)	524697.SZ	26 蓉环 V1	AAA	1.93
4.95Y	134948.SZ	26 和美 V1	AA+	2.32
4.95Y	281997.SH	26 鑫泰 01	AA+	2.5
4.96Y	244885.SH	26CHNG3K	AAA	1.83
4.96Y	244885.SH	26CHNG3K	AAA	1.83
4.97Y	134951.SZ	26 无水 V1	AA	2.435
4.97Y+5Y	282192.SH	26 青城 08	AAA	2.33 行权
4.97Y+5Y	282192.SH	26 青城 08	AAA	2.33 行权
4.98Y(休 1)	282105.SH	26 中旭 02	AA	2.5
4.98Y	134997.SZ	26 绍城 03	AAA	2.15
4.98Y	134997.SZ	26 绍城 03	AAA	2.15
4.98Y	134997.SZ	26 绍城 03	AAA	2.15
4.98Y	134997.SZ	26 绍城 03	AAA	2.15
4.98Y	134997.SZ	26 绍城 03	AAA	2.15
4.98Y	282237.SH	26 柯城 01	AA	2.38
4.98Y	282237.SH	26 柯城 01	AA	2.38
4.98Y	282237.SH	26 柯城 01	AA	2.38
4.98Y	282237.SH	26 柯城 01	AA	2.38
4.98Y	282237.SH	26 柯城 01	AA	2.38
4.98Y	282237.SH	26 柯城 01	AA	2.38
5.55Y(休 2)	149677.SZ	21 深能 02	AAA	1.9
5.55Y(休 2)	149677.SZ	21 深能 02	AAA	1.9
5.55Y(休 2)	149677.SZ	21 深能 02	AAA	1.9
9.25Y+NY	243325.SH	华能 YK16	AAA	2.35 行权
9.25Y+NY	243325.SH	华能 YK16	AAA	2.35 行权
9.98Y	244957.SH	26CHNG6K	AAA	2.2
13.78Y	242339.SH	25 中化 01	AAA	2.7
19D+2Y	115334.SH	23 诚通 07	AAA	1.50 行权
20D	149424.SZ	21 广铁 02	AAA	1.47
46D(休 1)	188131.SH	21 安信 G2	AAA	1.41
65D	251336.SH	23 冀交 04	AAA	1.54
68D	188228.SH	21 中企 01	AA+	1.63
68D	188228.SH	21 中企 01	AA+	1.63
68D	251419.SH	23 古厝 03	AAA	1.56
77D+NY	149529.SZ	21 申证 Y1	AAA	1.49 行权
110D+2Y	115717.SH	23 吉高 02	AAA	1.55 行权
110D+2Y	115717.SH	23 吉高 02	AAA	1.55 行权
110D	2322008.IB	23 民生租赁货运物流主题债 03	AAA	1.55
111D	149575.SZ	21 申证 09	AAA	1.45
116D(休 1)	136599.SH	16 首旅 02	AAA	1.48
131D	115805.SH	23 首钢 03	AAA	1.51
133D	241473.SH	24 交建 K1	AAA	1.49
139D	243667.SH	25 管网 SK	AAA	1.49
139D	243667.SH	25 管网 SK	AAA	1.49
156D	115936.SH	23 沪开 02	AA+	1.61
158D(休 1)	188730.SH	21 穗建 03	AAA	1.6
222D+NY(休 1)	149700.SZ	21 申证 Y3	AAA	1.52 行权
223D	136819.SH	16 川发 01	AAA	1.52
223D	149703.SZ	21 广发 20	AAA	1.46
223D	149703.SZ	21 广发 20	AAA	1.46
240D	137183.SH	23 潞安 EB	AAA	103.80 净价
256D(休 1)	253391.SH	23 渭控 02	AA+	1.8
264D+NY(休 1)	240445.SH	铁建 YK07	AAA	1.6 行权

293D+NY	185337.SH	22 华泰 Y1	AAA	1.53 行权
296D+NY	240552.SH	鲁高 KY04	AAA	1.6 行权
296D+NY	240552.SH	鲁高 KY04	AAA	1.6 行权
296D+NY	240552.SH	鲁高 KY04	AAA	1.6 行权
304D(休 9)	253872.SH	24 漳交 01	AAA	1.6
333D(休 1)	281810.SH	26 长旅 02	AA	2
333D(休 1)	281810.SH	26 长旅 02	AA	2
341D	253991.SH	24 武经 01	AAA	1.6
344D	134923.SZ	26 古厝 D1	AAA	1.62
352D+2Y	133991.SZ	25 大悦 01	AAA	2.15 行权
356D	184283.SH	22 上饶 01	AAA	1.62
364D	524206.SZ	25 长江 01	AAA	1.51
1.13Y+2Y	241012.SH	24 成渝 01	AAA	1.61 行权
1.17Y(休 1)	185869.SH	22 铁工 04	AAA	1.57
1.17Y+2Y	241102.SH	24 首城 02	AAA	2.05 行权
1.18Y+2Y	254985.SH	24 红投 02	AA+	1.95 行权
1.18Y+2Y	254985.SH	24 红投 02	AA+	1.95 行权
1.19Y	255024.SH	24 霍山 01	AA+	1.67
1.2Y+2Y	241169.SH	24 虞国 01	AA+	1.64 行权
1.29Y	243362.SH	25 国保 02	AAA	1.7
1.29Y	243362.SH	25 国保 02	AAA	1.7
1.43Y+5Y	184567.SH	22 蓉金 02	AAA	1.65 行权
1.46Y	243831.SH	25 浙商 02	AAA	1.63
1.47Y	152599.SH	20 晋江 01	AA+	1.65
1.54Y+6Y(休 1)	148961.SZ	24 粤财 02	AAA	1.65 行权
1.57Y	241875.SH	建材 K9	AAA	1.61
1.62Y+2Y	256536.SH	24 安化 01	AA	1.75 行权
1.69Y	242147.SH	24 国管 04	AAA	1.62
1.72Y	152699.SH	20 泗阳债	AA	1.765
1.75Y+2Y	257057.SH	25 浙城 01	AA+	1.85 行权
1.76Y	524109.SZ	25 深机 01	AAA	1.64
1.76Y	244511.SH	26 中证 G1	AAA	1.63
1.77Y(休 1)	257291.SH	25 潍坊 01	AAA	1.9
1.87Y(休 2)	257458.SH	25 鹰旅 01	AA	2.08
1.87Y(休 1)	032580116.IB	25 江阴城发 PPN001	AA+	1.805
1.88Y	242469.SH	25 株高 G3	AA+	1.9
1.91Y	244679.SH	26 银河 G3	AAA	1.63
1.94Y(休 2)	244874.SH	26 国租 01	AAA	100.00 净价
1.94Y(休 2)	244874.SH	26 国租 01	AAA	100.00 净价
1.97Y	242657.SH	25 中乡 K1	AAA	1.85
1.97Y	242657.SH	25 中乡 K1	AAA	1.85
1.97Y	282204.SH	26 赣建 01	AA+	1.91
2.02Y+2Y	258076.SH	25 泰山 05	AA+	2.24 行权
2.04Y	242887.SH	25 皖交 01	AAA	1.65
2.04Y	242887.SH	25 皖交 01	AAA	1.65
2.04Y	242887.SH	25 皖交 01	AAA	1.67
2.04Y	242887.SH	25 皖交 01	AAA	1.67
2.04Y	242887.SH	25 皖交 01	AAA	1.67
2.06Y+2Y	524258.SZ	25 宝安产发 01	AAA	1.71 行权
2.13Y	243040.SH	GC 核融 08	AAA	1.72
2.23Y(休 2)	241190.SH	24 招证 G3	AAA	1.62
2.24Y	259202.SH	康欣 VZ01	AA	2.07
2.27Y(休 2)	524366.SZ	25 吉电 K1	AAA	1.71
2.28Y+2Y	134365.SZ	25 镇旅 01	AA+	1.93 行权
2.28Y	148383.SZ	23 蛇口 02	AAA	1.92

2.29Y(休 1)	243288.SH	25 投控 02	AAA	100.00 净价
2.3Y+2Y(休 1)	259441.SH	25 长经 03	AA+	1.845 行权
2.41Y	243699.SH	25 吴发 G2	AA+	1.78
2.43Y+2Y	243738.SH	25 吉高 01	AAA	1.80 行权
2.46Y+NY(休 1)	243876.SH	路建 YK10	AAA	1.94 行权
2.46Y+NY(休 1)	243876.SH	路建 YK10	AAA	1.95 行权
2.56Y+NY(休 1)	244014.SH	路建 YK11	AAA	1.96 行权
2.67Y+NY(休 1)	280928.SH	25 国生 Y1	AAA	2.07 行权
12D	2320016.IB	23 北京银行小微债 01	AAA	1.39
40D	212380005.IB	23 光大银行债 01	AAA	1.4
52D(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	1.46
52D(休 2)	292380003.IB	23 新开发银行债 01BC	AAA	1.5625
63D+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	--/--	1.43 行权
63D+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	--/--	1.43 行权
63D+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	--/--	1.43 行权
124D+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	--/--	1.49 行权
124D+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	--/--	1.49 行权
194D+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	1.52 行权
215D+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	--/--	1.51 行权
231D+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	1.51 行权
232D+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	1.52 行权
232D+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	1.52 行权
232D+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	1.52 行权
232D+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	1.52 行权
232D+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	--/--	1.5 行权
243D+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	--/--	1.53 行权
250D+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	1.525 行权
251D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	--/--	1.5125 行权
251D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	--/--	1.5125 行权
251D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	--/--	1.5125 行权
251D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	--/--	1.5125 行权
287D+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	--/--	1.52 行权
287D+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	--/--	1.52 行权
323D+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	--/--	1.525 行权
323D+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	--/--	1.53 行权
1.01Y(休 1)	212480009.IB	24 上海银行债 01	AAA	1.5
1.01Y(休 1)	212480009.IB	24 上海银行债 01	AAA	1.505
1.02Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	--/--	1.53 行权
1.02Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	--/--	1.53 行权
1.02Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	--/--	1.53 行权
1.05Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	--/--	1.51 行权
1.05Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	--/--	1.51 行权
1.05Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	--/--	1.51 行权
1.05Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	--/--	1.51 行权
1.05Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	--/--	1.51 行权
1.05Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	--/--	1.51 行权
1.12Y(休 1)	2420018.IB	24 北京银行 03	AAA	1.52
1.13Y	2420019.IB	24 徽商银行 01	AAA	1.53
1.19Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	--/--	1.54 行权
1.2Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.545 行权
1.2Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.5475 行权
1.2Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.5475 行权
1.2Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.5475 行权
1.2Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.5475 行权

1.26Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.52
1.3Y(休 1)	292480010.IB	24 新开发银行债 02BC	AAA	1.635
1.3Y(休 1)	292480010.IB	24 新开发银行债 02BC	AAA	1.635
1.3Y(休 1)	292480010.IB	24 新开发银行债 02BC	AAA	1.635
1.3Y(休 1)	292480010.IB	24 新开发银行债 02BC	AAA	1.635
1.34Y+1Y(休 2)	312410003.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01A	--/--	1.565 行权
1.37Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	1.53
1.37Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	1.53
1.37Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	1.53
1.45Y(休 2)	212400009.IB	24 江南农商行债 01	AAA	1.595
1.45Y(休 2)	2420042.IB	24 齐鲁银行小微债	AAA	1.595
1.45Y(休 2)	2420042.IB	24 齐鲁银行小微债	AAA	1.595
1.46Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	1.57 行权
1.46Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	1.57 行权
1.46Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	1.57 行权
1.46Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	1.57 行权
1.46Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	1.57 行权
1.46Y	212400010.IB	24 中原银行小微债 01	AAA	1.63
1.47Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	--/--	1.535
1.47Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	--/--	1.535
1.47Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	--/--	1.535
1.47Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	--/--	1.535
1.47Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	--/--	1.535
1.47Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	--/--	1.535
1.55Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	--/--	1.5775 行权
1.55Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	--/--	1.5875 行权
1.57Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	1.60 行权
1.57Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	1.60 行权
1.57Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	1.60 行权
1.57Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	1.60 行权
1.57Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	1.60 行权
1.57Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	1.60 行权
1.57Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	1.60 行权
1.57Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	1.60 行权
1.57Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	1.60 行权
1.57Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	1.60 行权
1.59Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	--/--	1.58 行权
1.59Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	--/--	1.58 行权
1.6Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	--/--	1.58 行权
1.87Y	2520001.IB	25 北京银行小微债 01	AAA	1.575
2.01Y	222580003.IB	25 交行绿债 01A(BC)	--/--	1.505
2.01Y	222580003.IB	25 交行绿债 01A(BC)	--/--	1.505
2.05Y	2528007.IB	25 浦发银行 01	AAA	1.565
2.05Y	2528007.IB	25 浦发银行 01	AAA	1.565
2.09Y	222580006.IB	25 浙商银行绿债 01BC	AAA	1.57
2.1Y(休 1)	2528009.IB	25 浦发银行科创债 01	AAA	1.565
2.19Y	2520018.IB	25 南京银行绿色债 01	AAA	1.575
2.19Y	2520018.IB	25 南京银行绿色债 01	AAA	1.575
2.2Y	2528019.IB	25 兴业银行绿色债 02	AAA	1.55
2.25Y+1Y	312510006.IB	25 中行 TLAC 非资本债 01(BC)	--/--	1.645 行权
2.25Y+1Y	312510006.IB	25 中行 TLAC 非资本债 01(BC)	--/--	1.645 行权
2.28Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	--/--	1.665 行权
2.29Y+1Y	312510007.IB	25 交行 TLAC 非资本债 02A(BC)	--/--	1.65 行权
2.33Y+1Y(休 1)	312510009.IB	25 农行 TLAC 非资本债 02A(BC)	AAA	1.65 行权
2.36Y+1Y(休 1)	312510012.IB	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	--/--	1.71 行权
2.43Y	222500008.IB	25 北部湾银行绿债 01	AAA	1.7

2.68Y	2520061.IB	25 徽商银行小微债	AAA	1.66
2.68Y	2520061.IB	25 徽商银行小微债	AAA	1.66
2.68Y	2520061.IB	25 徽商银行小微债	AAA	1.66
2.7Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	1.7025 行权
2.7Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	1.7025 行权
2.83Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.70 行权
2.83Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.70 行权
2.83Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.70 行权
2.83Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.705 行权
2.95Y+5Y(休 1)	1928003.IB	19 农业银行二级 01	AAA	1.715 行权
3Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	--/--	1.72 行权
3Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	--/--	1.725 行权
3.01Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AAA	1.73 行权
3.1Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.77 行权
3.18Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	1.83 行权
3.25Y+5Y(休 1)	232400025.IB	24 恒丰银行二级资本债 02	AAA	1.92 行权
3.26Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	--/--	1.785 行权
3.31Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	--/--	1.79 行权
3.33Y+5Y(休 2)	232400032.IB	24 成都银行二级资本债 02	AAA	1.85 行权
3.36Y+NY(休 1)	242400016.IB	24 民生银行永续债 01	AAA	2.025 行权
3.39Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	--/--	1.79 行权
3.39Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	--/--	1.79 行权
3.39Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	--/--	1.79 行权
3.39Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	--/--	1.79 行权
3.39Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	--/--	1.775 行权
3.58Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	--/--	1.86 行权
3.58Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	--/--	1.86 行权
3.58Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	--/--	1.86 行权
3.58Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	--/--	1.89 行权
3.64Y+NY	242480082.IB	24 农行永续债 03BC	AAA	1.835 行权
3.64Y+NY	242480082.IB	24 农行永续债 03BC	AAA	1.835 行权
3.64Y+NY	242480082.IB	24 农行永续债 03BC	AAA	1.835 行权
3.64Y+NY	242480082.IB	24 农行永续债 03BC	AAA	1.835 行权
3.67Y+5Y(休 1)	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A	AAA	1.82 行权
3.67Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	--/--	1.8375 行权
3.67Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	--/--	1.84 行权
3.73Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	--/--	1.83 行权
3.73Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	--/--	1.83 行权
3.9Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	--/--	1.855 行权
3.9Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	--/--	1.855 行权
3.9Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	--/--	1.855 行权
3.9Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	--/--	1.86 行权
3.91Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	1.985 行权
3.91Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	1.985 行权
3.91Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	1.985 行权
3.91Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	1.985 行权
3.97Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	--/--	1.86 行权
3.97Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	--/--	1.8625 行权
3.97Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	--/--	1.87 行权
3.97Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	--/--	1.87 行权
4.04Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC	AAA	1.945 行权
4.04Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC	AAA	1.95 行权
4.04Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC	AAA	1.95 行权
4.04Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC	AAA	1.95 行权
4.04Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC	AAA	1.95 行权

4.64Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	--/--	2.01 行权
4.64Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	--/--	2.01 行权
4.65Y+5Y(休 2)	232580051.IB	25 长沙银行二级资本债 01	AAA	2.12 行权
4.65Y+5Y(休 2)	232580051.IB	25 长沙银行二级资本债 01	AAA	101.0178 净价
4.65Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.08 行权
4.65Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.08 行权
4.65Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.085 行权
4.65Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.085 行权
4.65Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.085 行权
4.67Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	--/--	1.9925 行权
4.67Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	--/--	1.995 行权
4.67Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	--/--	2.005 行权
4.67Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	--/--	2.0075 行权
4.67Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	--/--	2.0075 行权
4.67Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	--/--	2.0075 行权
4.67Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	--/--	2.0075 行权
4.67Y+5Y(休 1)	232580055.IB	25 徽商银行二级资本债 01	AAA	2.145 行权
4.69Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.06 行权
4.69Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.06 行权
4.69Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.06 行权
4.69Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.06 行权
4.69Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.07 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.995 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.995 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.995 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.995 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.995 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.995 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.995 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.9975 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.9975 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.9975 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	1.9975 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	2.00 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	2.005 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	2.005 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	2.005 行权
4.71Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	--/--	2.01 行权
5.59Y+5Y(休 1)	2128034.IB	21 建设银行二级 04	--/--	2.02 行权
5.61Y+5Y(休 1)	2128040.IB	21 中国银行二级 04	--/--	2.02 行权
6.19Y+5Y	2228040.IB	22 建设银行二级 02	--/--	2.075 行权
6.55Y+5Y	092280109.IB	22 中行二级资本债 02B	--/--	2.105 行权
6.55Y+5Y	092280109.IB	22 中行二级资本债 02B	--/--	2.105 行权
6.58Y+5Y(休 2)	092280132.IB	22 建行二级资本债 02B	--/--	2.10 行权
7.39Y+5Y	232380037.IB	23 工行二级资本债 02B	--/--	2.17 行权
7.39Y+5Y	232380037.IB	23 工行二级资本债 02B	--/--	2.17 行权
7.39Y+5Y	232380037.IB	23 工行二级资本债 02B	--/--	2.17 行权
7.44Y+5Y	232380053.IB	23 农行二级资本债 02B	AAA	2.17 行权
7.44Y+5Y	232380053.IB	23 农行二级资本债 02B	AAA	2.17 行权
7.44Y+5Y	232380053.IB	23 农行二级资本债 02B	AAA	2.17 行权
7.56Y+5Y(休 1)	232380074.IB	23 农行二级资本债 03B	AAA	2.185 行权
7.82Y+5Y	232480002.IB	24 中行二级资本债 01B	--/--	2.20 行权
7.82Y+5Y	232480002.IB	24 中行二级资本债 01B	--/--	2.205 行权
7.82Y+5Y	232480002.IB	24 中行二级资本债 01B	--/--	2.205 行权
7.82Y+5Y	232480002.IB	24 中行二级资本债 01B	--/--	2.205 行权
7.83Y+5Y(休 2)	232480007.IB	24 建行二级资本债 01B	--/--	2.195 行权
7.83Y+5Y(休 2)	232480007.IB	24 建行二级资本债 01B	--/--	2.195 行权

7.83Y+5Y(休 2)	232480007.IB	24 建行二级资本债 01B	--/--	2.205 行权
7.83Y+5Y(休 2)	232480007.IB	24 建行二级资本债 01B	--/--	2.205 行权
7.83Y+5Y(休 2)	232480007.IB	24 建行二级资本债 01B	--/--	2.21 行权
7.83Y+5Y(休 1)	232480005.IB	24 农行二级资本债 01B	AAA	2.20 行权
7.83Y+5Y(休 1)	232480005.IB	24 农行二级资本债 01B	AAA	2.205 行权
7.83Y+5Y(休 1)	232480005.IB	24 农行二级资本债 01B	AAA	2.205 行权
7.83Y+5Y(休 1)	232480005.IB	24 农行二级资本债 01B	AAA	2.205 行权
7.83Y+5Y(休 1)	232480005.IB	24 农行二级资本债 01B	AAA	2.205 行权
7.83Y+5Y(休 1)	232480005.IB	24 农行二级资本债 01B	AAA	2.22 行权
9.29Y+5Y	232580025.IB	25 农行二级资本债 02B(BC)	AAA	2.30 行权
9.62Y+5Y	232580047.IB	25 农行二级资本债 04B(BC)	AAA	2.34 行权
9.62Y+5Y	232580047.IB	25 农行二级资本债 04B(BC)	AAA	2.345 行权
9.62Y+5Y	232580047.IB	25 农行二级资本债 04B(BC)	AAA	2.35 行权
9.62Y+5Y	232580047.IB	25 农行二级资本债 04B(BC)	AAA	2.355 行权

免责声明：本日评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、发表或引用日评内容。日评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评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。