



【2024-04-15】

国债

央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，4月15日以利率招标方式开展了20亿元7天期逆回购操作，中标利率为1.8%。同时开展1000亿元1年期中期借贷便利（MLF）操作，中标利率为2.5%，与此前一致。Wind数据显示，当日40亿元逆回购到期，因此单日净投放980亿元。此外，本月有1700亿元MLF到期，将于周三（4月17日）到期。Wind数据显示，本周（4月13日至4月19日）央行公开市场将有120亿元逆回购到期，其中周一到期40亿元，周二至周五每日到期20亿元。

国债方面 288D 240002 1.6725-1.6775； 362D 200005 1.685-1.7025； 3.28Y 220016 2.0375-2.045； 4.51Y 230022 2.085-2.1175； 6.7Y 230028 2.2375-2.27； 9.62Y 230026 2.317-2.335； 29.01Y 230009 2.5375-2.55。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.5600	1.9775	2.1200	2.2600	2.3500	2.5460
今日国债(%)	1.5700	2.0000	2.1225	2.2560	2.3475	2.5475
变动(%)	0.0100	0.0225	0.0025	-0.0040	-0.0025	0.0015

金融债

金融债方面 148D 230211 1.81； 285D 240301 1.82-1.825； 2.87Y 220203 2.075-2.095； 4.42Y 230415 2.215-2.245； 6.88Y 210205 2.33-2.36； 9.42Y 230215 2.43-2.45。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.7000	2.0650	2.2250	2.3700	2.4450
今日非国开金融债(%)	1.7300	2.0600	2.2400	2.3800	2.4400
变动(%)	0.0300	-0.0050	0.0150	0.0100	-0.0050
昨日国开债(%)	1.7450	2.0525	2.1550	2.3200	2.4330
今日国开债(%)	1.8100	2.0700	2.1750	2.3200	2.4245
变动(%)	0.0650	0.0175	0.0200	0.0000	-0.0085

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Q3期限。短端方面，32D 012384170.IB 23金隅 SCP005 AAA 在2.00%成交（估值-8位置），基金出给基金；74D 012481210.IB 24中兴通讯 SCP033 AAA 在2.01%成交（估值-4位置），银行出给基金。中长端方面，116D 012384084.IB 23深圳地铁 SCP007 AAA 在2.07%成交（估值-2位置），银行出给基金；186D 012481232.IB 24上海医药 SCP002 AAA 在2.10%成交（估值-9位置），银行出给基金。长端方面，197D 012480460.IB 24首钢 SCP001 AAA 在2.13%成交（估值-7位置），理财出给基金；360D 042480199.IB 24南电 CP003 AAA 在2.11%成交，估值-1，银行出给基金。总体而言，短端、中长端和长端收益均下行。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	2.1		2.19		2.25		2.3		2.39	
	AA+	2.23		2.32		2.4		2.46		2.52	
	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	2.12	-2	2.21	-2	2.28	-3	2.33	-3	2.41	-2
	AA+	2.25	-2	2.35	-3	2.42	-2	2.49	-3	2.55	-3

	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

今日中票交投情绪较为活跃。1-3 年短端中票，22 云能 MTN0010（AAA，1.53Y）在 2.35%成交，估值附近成交；23 广州地铁 MTN003（AAA，2.03Y）在 2.32%成交，低估值 1bp 成交；23 中建 MTN001（AAA，2.18Y）成交在 2.47%，低估值 1bp 成交；3 到 5 年期限，24 蓉城轨交 MTN002（AAA，4.8Y）在 2.54%成交，估值附近成交；24 嘉兴城投 MTN001B（AAA，4.89Y）成交在 2.6%，低估值 2bp 成交。5Y 及以上期限，24 苏国信 MTN001（AAA，9.98Y）成交在 2.69%，高估值 2bp 成交。总体而言，今日中票收益略有下行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.12		2.35		2.46		2.63		None	
	AAA	2.24		2.45		2.58		None		None	
	AA+	2.33		2.62		2.82		None		None	
	AA	2.42		2.8		3.25		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.15	-3	2.38	-3	2.47	-1	2.63	0	None	None
	AAA	2.26	-2	2.48	-3	2.59	-1	None	None	None	None
	AA+	2.35	-2	2.64	-2	2.84	-2	None	None	None	None
	AA	2.44	-2	2.81	-1	3.25	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，22 招路 01 AAA 成交在 2.26%，券商资管卖出，基金买入。21 深 G11 AAA 成交在 2.33%。保险卖出，券商买入。22 华电 04 AAA 成交在 2.37%。城投方面，20 济南城建债 01 AAA 成交在 2.35%。24 扬子 03 AAA 成交在 2.58%，银行卖出，基金买入。22 温高新债 01 AAA 成交在 2.60%。长端方面，24 建工 K1 AAA 成交在净价 100。24 中化 02 AAA 成交在 2.75%。基金卖出，保险买入。

美元债

市场整体安静投资版块几乎无波动，阿里巴巴 BABA，腾讯 TENCNT 等名字有少量交投上下 1bp 小幅波动。城投版块美元债交投清淡，26-27s 点心债名字成近期市场供给的主力军。地产版块，短端万科交投活跃较上周五日内上涨约 2-3pts，尾盘市场 ofr 在 95 附近，新城 FUTLAN 24 今日有成交。

今日短融成交

剩余天数	债券代码	债券代码（发行机构）	评级	收益率
4D	012480211.IB	24 宁沪高 SCP001	AAA	2.00%
8D	072310189.IB	23 长城证券 CP009	AAA	1.90%
8D	072310189.IB	23 长城证券 CP009	AAA	1.93%
21D	012382973.IB	23 深燃气 SCP007	AAA	2.01%
29D	012383118.IB	23 津城建 SCP053	AAA	2.20%
32D	012384170.IB	23 金隅 SCP005	AAA	2.00%
41D(休 1)	012383307.IB	23 武清经开 SCP007	AA	2.33%
42D	012480574.IB	24 国家能源 SCP001	AAA	1.99%
42D	012480574.IB	24 国家能源 SCP001	AAA	1.99%
57D	012383565.IB	23 川投资 SCP001	AAA	2.08%
81D	012383682.IB	23 海沧投资 SCP012	AA+	2.17%
93D	012480945.IB	24 凯盛科技 SCP003	AAA	2.14%
93D	012480945.IB	24 凯盛科技 SCP003	AAA	2.14%
93D	012480945.IB	24 凯盛科技 SCP003	AAA	2.14%
99D	072410041.IB	24 长城证券 CP003	AAA	2.01%
113D	012481203.IB	24 晋交投 SCP002	AA+	2.18%
116D	012481256.IB	24 杭州热联 SCP005	AA+	2.24%
116D	012384084.IB	23 深圳地铁 SCP007	AAA	2.07%
120D	012384147.IB	23 桂交投 SCP006	AAA	2.23%
127D	012480552.IB	24 杭州钢铁 SCP001	AAA	2.14%
130D	012384309.IB	23 东莞实业 SCP002	AA+	2.19%
146D(休 1)	012480826.IB	24 华远陆港 SCP002	AAA	2.16%
168D	012481187.IB	24 中建七局 SCP003(科创票据)	AAA	2.10%
168D	012481187.IB	24 中建七局 SCP003(科创票据)	AAA	2.10%
186D	012481232.IB	24 上海医药 SCP002	AAA	2.10%
186D	012481232.IB	24 上海医药 SCP002	AAA	2.10%
186D	012481232.IB	24 上海医药 SCP002	AAA	2.10%
186D	012481232.IB	24 上海医药 SCP002	AAA	2.10%

197D	012480460.IB	24 首钢 SCP001	AAA	2.13%
200D	012480491.IB	24 陕建集团 SCP002	AAA	2.57%
245D	012480989.IB	24 厦路桥 SCP001	AAA	2.18%
360D	042480199.IB	24 南电 CP003	AAA	2.11%

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
8D	102100780.IB	21 中电国际 MTN001	AAA	2.05%
10D	101900608.IB	19 青岛城投 MTN002	AAA	2.08%
35D	102281095.IB	22 平安租赁 MTN005	AAA	2.23%
36D+2Y	102100975.IB	21 冀建投 MTN001	AAA	2.00%
47D(休 2)	102101011.IB	21 国家能源 MTN001	AAA	2.08%
85D	102101263.IB	21 巨化 MTN002	AA+	2.14%
91D	101900910.IB	19 粤铁建 MTN002	AAA	2.12%
130D	102281882.IB	22 滨江房产 MTN001	AAA	3.00%
138D(休 2)	102101748.IB	21 贵州高速 MTN007	AAA	2.25%
190D	101901400.IB	19 闽高速 MTN004	AAA	2.12%
209D(休 1)	102102271.IB	21 沪硅产业 MTN001	AA+	2.34%
225D+NY	102103099.IB	21 鲁高速 MTN008	AAA	2.33%
225D+NY	102103099.IB	21 鲁高速 MTN008	AAA	2.33%
232D+2Y	102103166.IB	21 诚通控股 MTN007	AAA	2.15%
239D	102103230.IB	21 华润 MTN005	AAA	2.10%
239D	102103230.IB	21 华润 MTN005	AAA	2.10%
239D	102103230.IB	21 华润 MTN005	AAA	2.10%
239D	102103230.IB	21 华润 MTN005	AAA	2.10%
257D(休 2)	102103343.IB	21 南航股 MTN004	AAA	2.15%
309D	102280292.IB	22 江宁科学 MTN001	AA+	2.26%
325D	102000276.IB	20 九龙江 MTN001	AAA	2.32%
327D+NY(休 2)	102280448.IB	22 鲁高速 MTN002	AAA	2.35%
343D+2Y	102280604.IB	22 桂铁投 MTN002	AAA	2.32%
1.03Y(休 2)	102280953.IB	22 华能江苏 MTN001(碳中和债)	AAA	2.18%
1.03Y(休 2)	102280953.IB	22 华能江苏 MTN001(碳中和债)	AAA	2.18%
1.03Y(休 2)	102280953.IB	22 华能江苏 MTN001(碳中和债)	AAA	2.18%
1.07Y	102281060.IB	22 上海大众 MTN001	AAA	2.35%
1.17Y+1Y	102381400.IB	23 巩义国资 MTN002	AA	2.65%
1.17Y	102281307.IB	22 首钢 MTN003	AAA	2.25%
1.25Y	102281562.IB	22 盐城交投 MTN002	AAA	2.40%
1.39Y+NY	102382373.IB	23 中电投 MTN037(能源保供特别债)	AAA	2.32%
1.45Y(休 1)	102282170.IB	22 通州湾 MTN002	AA	2.45%
1.52Y	102282292.IB	22 通商租赁 MTN002	AAA	2.37%
1.59Y	102383083.IB	23 云投 MTN002	AAA	2.75%
1.69Y+NY	102282772.IB	22 鲁高速 MTN009	AAA	2.43%
1.74Y(休 1)	102480104.IB	24 景德镇陶 MTN001	AA+	2.85%
1.95Y	102481225.IB	24 云建投 MTN008	AAA	3.05%
1.99Y(休 1)	102481452.IB	24 溧水经开 MTN003	AA+	2.55%
2.12Y	102381249.IB	23 绿城房产 MTN002	AAA	4.07%
2.32Y	102382013.IB	23 宜兴城投 MTN002	AA+	2.46%
2.37Y	102101714.IB	21 大横琴 MTN001	AAA	2.50%
2.39Y+NY(休 2)	102382365.IB	23 川高速 MTN006(革命老区)	AAA	2.52%
2.51Y(休 1)	102102068.IB	21 中国旅游 MTN001	AAA	2.36%
2.75Y	102280056.IB	22 粤交投 MTN001	AAA	2.36%
2.78Y(休 1)	102480264.IB	24 西安高新 MTN001	AAA	2.75%
2.8Y	102480445.IB	24 洋浦开发 MTN001	AA	2.62%
2.9Y	102480778.IB	24 北部湾 MTN004	AAA	2.73%
2.91Y(休 2)	102480850.IB	24 吉利 MTN001(科创票据)	AAA	2.75%
2.91Y(休 2)	102480850.IB	24 吉利 MTN001(科创票据)	AAA	2.75%
2.93Y+NY(休 1)	102481022.IB	24 中化股 MTN002	AAA	2.52%
2.93Y+NY(休 1)	102481022.IB	24 中化股 MTN002	AAA	2.52%
2.93Y+NY(休 1)	102481022.IB	24 中化股 MTN002	AAA	2.52%
2.93Y(休 1)	102481054.IB	24 皖能源 MTN001(碳中和债)	AAA	2.37%
2.95Y	102481300.IB	24 泉州国资 MTN001	AA+	2.55%
3.75Y(休 1)	102380090.IB	23 华为 MTN001	AAA	2.55%
4.87Y	102480542.IB	24 义乌国资 MTN001	AAA	2.65%
4.89Y	102480723.IB	24 广州地铁 MTN003	AAA	2.53%
4.9Y	102480774.IB	24 桂投资 MTN002	AAA	3.04%
4.9Y	102480774.IB	24 桂投资 MTN002	AAA	3.04%
4.9Y	102480774.IB	24 桂投资 MTN002	AAA	3.04%
4.9Y	102480752.IB	24 蜀道投资 MTN004	AAA	2.58%

4.9Y	102480752.IB	24 蜀道投资 MTN004	AAA	2.58%
4.92Y	102480901.IB	24 四川机场 MTN003	AAA	2.57%
4.93Y	102480958.IB	24 浙资运营 MTN002	AAA	2.58%
4.95Y	102481260.IB	24 津城建 MTN015	AAA	3.5805%
4.99Y	102481398.IB	24 海淀国资 MTN003B	AAA	2.81%
4.99Y	102481398.IB	24 海淀国资 MTN003B	AAA	2.82%

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
11D	188047.SH	21 华泰 G3	AAA	2.00%
39D	188135.SH	21 华能 01	AAA	2.00%
96D(休 2)	127518.SH	PR 嵊州债	AA+/AAA	2.15%
96D(休 2)	127518.SH	PR 嵊州债	AA+/AAA	2.15%
103D(休 2)	127550.SH	PR 包头 01	AA/AAA	2.40%
126D	155623.SH	19 川发 03	AAA	2.14%
128D	127595.SH	PR 兴蜀债	AA/AAA	2.35%
130D+2Y(休 1)	188630.SH	21 中车 G1	AAA	2.10%
140D+NY(休 1)	188679.SH	21 济建 Y1	AAA	2.29%
140D+NY(休 1)	188679.SH	21 济建 Y1	AAA	2.29%
143D	148448.SZ	23 申宏 03	AAA	2.08%
196D+1.99Y	188900.SH	21 杭金 01	AAA	2.19%
213D	240225.SH	23 中证 C1	AAA/A-1	2.09%
217D+2Y	185011.SH	21 诚通 19	AAA	2.20%
219D	1780370.IB	17 建德国资债	AA	2.32%
228D+2Y(休 1)	185033.SH	21 诚通 21	AAA	2.20%
272D(休 1)	185235.SH	22 诚通 01	AAA	2.20%
277D	185280.SH	22 国电 01	AAA	2.12%
278D(休 2)	185240.SH	G22 长电 1	AAA	2.10%
308D	114963.SH	23 惠临 01	AA	2.85%
325D	148198.SZ	23 申证 C1	AAA	2.16%
334D(休 2)	092280004.IB	22 东方债 01BC	AAA	2.27%
1.02Y+2Y	166593.SH	20 豫铁 01	AAA	2.34%
1.07Y(休 1)	251019.SH	23 昆城 02	AAA	2.34%
1.18Y+3Y	115538.SH	23 筑城 01	AAA	2.80%
1.2Y	194830.SH	22 南安 01	AA	2.54%
1.33Y	182434.SH	22 盐城 01	AAA	2.46%
1.4Y(休 1)	137771.SH	22 国元 G1	AAA	2.32%
1.43Y	133316.SZ	22 安信 05	AAA	2.35%
1.43Y	133316.SZ	22 安信 05	AAA	2.35%
1.43Y	133316.SZ	22 安信 05	AAA	2.35%
1.45Y+3Y	148073.SZ	22 南网 01	AAA	2.17%
1.45Y(休 1)	182771.SH	22 嵊开 01	AA/AA+	2.59%
1.45Y(休 1)	182771.SH	22 嵊开 01	AA/AA+	2.59%
1.51Y(休 2)	182904.SH	22 孝高 01	AA	2.60%
1.58Y	253033.SH	23 东乡 01	AA	2.96%
1.62Y	138609.SH	22 国投 G1	AAA	2.25%
1.68Y	148552.SZ	23 长城 11	AAA	2.29%
1.76Y	240501.SH	24 平证 01	AAA	2.30%
1.8Y+1Y	240586.SH	24 明债 01	AA+	2.93%
1.81Y	175733.SH	21 中铁 02	AAA	2.70%
1.91Y+2Y	250299.SH	23 浏城 01	AA+	2.50%
1.93Y	115069.SH	23 安控 05	AAA	2.42%
1.93Y	115069.SH	23 安控 05	AAA	2.42%
1.95Y(休 1)	250575.SH	23 平城 01	AA/AA+	2.60%
2.17Y	148326.SZ	23 长江 03	AAA	2.37%
2.17Y	148326.SZ	23 长江 03	AAA	2.37%
2.33Y	1980231.IB	19 莆田高新债	AA	2.74%
2.33Y	115781.SH	23 中证 16	AAA	2.31%
2.34Y(休 1)	196879.SH	21 淄博 02	AAA	2.71%
2.35Y+2Y	251797.SH	23 衡城 02	AA+	2.65%
2.39Y(休 1)	149624.SZ	21 深 G11	AAA	2.33%
2.56Y(休 2)	252875.SH	23 毫建 03	AA/AAA	2.78%
2.88Y	253908.SH	24 扬州 F1	AAA	2.50%
2.88Y	253908.SH	24 扬州 F1	AAA	2.50%
2.89Y+NY(休 1)	240690.SH	24 住总 Y1	AAA	2.62%
2.91Y+2Y	240663.SH	24 西高科	AA+	3.25%
2.93Y+2Y	240781.SH	24 明债 03	AA+	3.54%
2.95Y	254258.SH	24 吴开 01	AA+	2.57%
2.95Y	254264.SH	24 青云 01	AA/AA+	4.05%
2.95Y+NY(休 2)	148669.SZ	24 兴城 YK03	AAA	2.59%
2.97Y+2Y	148678.SZ	24 长轨 G1	AAA	2.48%

2.97Y+2Y	148678.SZ	24 长轨 G1	AAA	2.48%
2.99Y(休 2)	148686.SZ	24 广金 03	AAA	2.45%
2.99Y(休 1)	254428.SH	24 椒发 01	AA+	2.63%
3.1Y(休 1)	2222003.IB	22 国开金融债	AAA	2.38%
3.26Y	137550.SH	22 华电 04	AAA	2.37%
3.49Y+NY(休 1)	137871.SH	22 中金 Y2	AAA	2.52%
3.55Y	138520.SH	22 蓉投 03	AAA	2.56%
4.88Y(休 1)	271140.SH	24 扬子 03	AAA	2.58%
4.88Y(休 1)	271140.SH	24 扬子 03	AAA	2.58%
4.89Y	240661.SH	24 中化 01	AAA	2.54%
4.89Y	240661.SH	24 中化 01	AAA	2.54%
4.89Y	240661.SH	24 中化 01	AAA	2.54%
4.89Y	240661.SH	24 中化 01	AAA	2.54%
9.89Y	240660.SH	24 建工 K1	AAA	100
9.89Y	240660.SH	24 建工 K1	AAA	100
9.89Y	240662.SH	24 中化 02	AAA	2.75%
232D+2Y	032191380.IB	21 拱墅投发 PPN002	AA+	2.28%
319D	032000132.IB	20 首发 PPN001	AAA	2.21%
328D+1Y	032380196.IB	23 永阳建设 PPN001	AA/AA+	2.44%
1.26Y(休 1)	032000650.IB	20 邵阳城投 PPN002	AA+	2.60%
1.43Y+1Y(休 2)	032380915.IB	23 沔东控股 PPN001	AA+	3.01%
2.49Y+2Y	032380971.IB	23 蓉经开 PPN002	AA+	2.73%
11D+5Y	1928011.IB	19 工商银行二级 03	AAA	1.97%
11D+5Y	1928011.IB	19 工商银行二级 03	AAA	1.97%
11D+5Y	1928011.IB	19 工商银行二级 03	AAA	1.97%
13D(休 1)	2128018.IB	21 渤海银行 02	AAA	1.93%
13D(休 1)	2128018.IB	21 渤海银行 02	AAA	1.93%
13D(休 1)	2128018.IB	21 渤海银行 02	AAA	1.93%
14D+5Y(休 1)	1928010.IB	19 平安银行二级	AAA	2.00%
37D	1920037.IB	19 青岛银行债 02	AAA	1.92%
50D+NY	1928013.IB	19 民生银行永续债	AAA	2.20%
56D(休 1)	2128023.IB	21 中信银行小微债	AAA	1.92%
56D(休 1)	2128023.IB	21 中信银行小微债	AAA	1.92%
106D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.13%
127D	2120071.IB	21 上海银行	AAA	1.98%
127D	2120071.IB	21 上海银行	AAA	1.98%
127D	2120071.IB	21 上海银行	AAA	1.98%
127D	2120071.IB	21 上海银行	AAA	1.98%
127D	2120071.IB	21 上海银行	AAA	1.98%
134D+5Y	1928022.IB	19 兴业银行二级 01	AAA	2.11%
134D+5Y	1928022.IB	19 兴业银行二级 01	AAA	2.10%
134D+5Y	1928022.IB	19 兴业银行二级 01	AAA	2.08%
157D+5Y	1928026.IB	19 兴业银行二级 02	AAA	2.10%
157D+5Y	1928026.IB	19 兴业银行二级 02	AAA	2.10%
165D	2128031.IB	21 工商银行绿色金融债 01	AAA	1.97%
165D	2128031.IB	21 工商银行绿色金融债 01	AAA	1.97%
165D	2120087.IB	21 东莞银行 01	AAA	2.06%
165D	2120087.IB	21 东莞银行 01	AAA	2.06%
208D(休 2)	2120098.IB	21 东莞银行 02	AAA	2.07%
235D	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	2.03%
239D	2128048.IB	21 民生银行 02	AAA	2.08%
240D+NY	1928036.IB	19 中信银行永续债	AAA	2.18%
255D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.23%
255D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.23%
255D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.23%
255D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.23%
309D	2220011.IB	22 北京银行小微债 01	AAA	2.09%
316D+NY	2028003.IB	20 平安银行永续债 01	AAA	2.24%
325D	2020006.IB	20 宁波银行小微债 02	AAA	2.09%
333D	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	2.06%
333D	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	2.06%
333D	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	2.06%
337D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.19%
337D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.19%
1.04Y	2228028.IB	22 中信银行 01	AAA	2.09%
1.04Y+NY	2028014.IB	20 中国银行永续债 01	AAA	2.20%
1.04Y+NY	2028014.IB	20 中国银行永续债 01	AAA	2.18%
1.04Y+NY	2028014.IB	20 中国银行永续债 01	AAA	2.18%
1.06Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.17%
1.06Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.15%
1.07Y+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.21%
1.07Y+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.21%

1.1Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.15%
1.1Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.15%
1.1Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.15%
1.1Y+NY	2020029.IB	20 东莞银行永续债	AAA/AA+	2.25%
1.11Y(休 1)	2228032.IB	22 建设银行绿色金融债 01	AAA	2.10%
1.21Y+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.275%
1.21Y+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.28%
1.23Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.21%
1.23Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.21%
1.23Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.21%
1.23Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.19%
1.3Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.18%
1.31Y	2228046.IB	22 中信银行 02	AAA	2.11%
1.31Y+5Y	2020043.IB	20 苏州银行二级	AAA/AA+	2.25%
1.33Y+5Y	2028024.IB	20 中信银行二级	AAA	2.21%
1.36Y+NY(休 1)	2028032.IB	20 农业银行永续债 02	AAA	2.20%
1.36Y+NY(休 1)	2028032.IB	20 农业银行永续债 02	AAA	2.19%
1.36Y+NY(休 1)	2028032.IB	20 农业银行永续债 02	AAA	2.19%
1.42Y+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.17%
1.42Y+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.17%
1.42Y+5Y	2028034.IB	20 浦发银行二级 03	AAA	2.20%
1.44Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.17%
1.44Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.17%
1.44Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.18%
1.45Y+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.20%
1.45Y+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.20%
1.55Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.22%
1.58Y	2228057.IB	22 浦发银行 04	AAA	2.15%
1.59Y+NY	2028048.IB	20 中国银行永续债 02	AAA	2.23%
1.93Y+5Y	2128008.IB	21 中国银行二级 01	AAA	2.205%
1.94Y+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	2.25%
2.12Y(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	2.18%
2.12Y(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	2.18%
2.12Y(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	2.17%
2.12Y(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	2.17%
2.15Y	2328018.IB	23 兴业银行绿色金融债 02	AAA	2.18%
2.18Y(休 1)	222380004.IB	23 光大银行绿债 01	AAA	2.18%
2.26Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.17%
2.26Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.17%
2.26Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.17%
2.26Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.17%
2.28Y(休 2)	2320032.IB	23 通商银行 02	AA+	2.44%
2.28Y(休 2)	2320032.IB	23 通商银行 02	AA+	2.44%
2.28Y(休 2)	2320032.IB	23 通商银行 02	AA+	2.44%
2.28Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.22%
2.32Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.27%
2.32Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.265%
2.36Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.28%
2.36Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.28%
2.36Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.28%
2.36Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.28%
2.41Y	2321028.IB	23 中山农商 01	AA+	2.45%
2.51Y+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	2.39%
2.56Y(休 2)	2328023.IB	23 浙商银行小微债 02	AAA	2.26%
2.58Y+5Y	2128036.IB	21 平安银行二级	AAA	2.355%
2.59Y+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	2.31%
2.59Y+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	2.31%
2.59Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	2.35%
2.61Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.33%
2.61Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.33%
2.61Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.33%
2.62Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.45%
2.62Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.45%
2.62Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.45%
2.62Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.45%
2.62Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.45%
2.67Y+5Y(休 1)	2128049.IB	21 建设银行二级 05	AAA	2.315%
2.67Y+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	2.315%
2.7Y+NY	2120118.IB	21 广州银行永续债	AAA/AA+	2.52%
2.82Y(休 5)	2428001.IB	24 平安银行小微债 01	AAA	2.27%
2.88Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	2.26%
2.88Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	2.26%

2.88Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	2.26%
2.89Y(休 2)	2420006.IB	24 桂林银行	AAA	2.46%
2.89Y+5Y(休 1)	2221006.IB	22 上海农商二级 01	AAA	2.38%
2.93Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	2.29%
2.93Y	2420011.IB	24 浙商银行小微债 01	AAA	2.30%
2.93Y	212480005.IB	24 光大银行债 01	AAA	2.26%
2.93Y	2420011.IB	24 浙商银行小微债 01	AAA	2.295%
2.93Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	2.26%
2.93Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	2.26%
2.93Y(休 1)	2420013.IB	24 北京银行 01	AAA	2.28%
2.95Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02	AAA	2.265%
2.95Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02	AAA	2.265%
3Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	2.35%
3Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	2.325%
3Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	2.325%
3.17Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.35%
3.17Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.3425%
3.17Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.3425%
3.17Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.345%
3.17Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.345%
3.55Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	2.30%
3.55Y+5Y	092202005.IB	22 国开行二级资本债 01A	--/--	2.29%
3.57Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.36%
3.58Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.375%
3.58Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.375%
3.69Y+5Y	232280007.IB	22 工行二级资本债 05A	AAA	2.36%
3.7Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.59%
3.7Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.59%
3.96Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.73%
4.12Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.54%
4.24Y+5Y	232380026.IB	23 厦门国际二级资本债 01	AAA	2.72%
4.24Y+5Y	232380026.IB	23 厦门国际二级资本债 01	AAA	2.72%
4.24Y+5Y	232380026.IB	23 厦门国际二级资本债 01	AAA	2.73%
4.52Y+5Y(休 1)	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A	AAA	2.435%
4.54Y+NY	242380023.IB	23 徽商银行永续债 01	AAA	2.70%
4.54Y+NY	242380023.IB	23 徽商银行永续债 01	AAA	2.70%
4.54Y+NY	242380023.IB	23 徽商银行永续债 01	AAA	2.70%
4.59Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	2.46%
4.59Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	2.45%
4.62Y+5Y(休 1)	232380082.IB	23 浙商银行二级资本债 02	AAA	2.57%
4.81Y+5Y(休 1)	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A	AAA	2.465%
4.81Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.485%
4.81Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.485%
4.98Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.50%
4.98Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.48%
4.98Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.47%
8.59Y+5Y(休 1)	092280140.IB	22 交行二级资本债 02B	AAA	2.64%
8.59Y+5Y(休 1)	092280140.IB	22 交行二级资本债 02B	AAA	2.64%
8.59Y+5Y(休 1)	092280140.IB	22 交行二级资本债 02B	AAA	2.64%
9.59Y+5Y	232380077.IB	23 建行二级资本债 03B	AAA	2.65%
9.98Y+5Y	232480009.IB	24 中行二级资本债 02B	AAA	2.65%