



【2024-12-12】

国债

央行发布公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，2024 年 12 月 12 日以固定利率、数量招标方式开展了 661 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率 1.50%。Wind 数据显示，当日 373 亿元逆回购到期。

国债方面 317D 240021 1.20-1.21； 2.93Y 240022 1.30-1.325； 4.59Y 240014 1.47-1.51； 6.53Y 240013 1.6675-1.695； 9.45Y 240011 1.805-1.8225； 28.84Y 230023 2.07-2.09。

|         | 1y      | 3y      | 5y      | 7y      | 10y     | 30y    |
|---------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|
| 昨日国债(%) | 1.2950  | 1.3500  | 1.5000  | 1.6900  | 1.8200  | 2.0800 |
| 今日国债(%) | 1.2650  | 1.3000  | 1.4650  | 1.6675  | 1.8100  | 2.0800 |
| 变动(%)   | -0.0300 | -0.0500 | -0.0350 | -0.0225 | -0.0100 | 0.0000 |

金融债

金融债方面 225D 240421 1.49-1.50； 4.2Y 240203 1.57-1.61； 6.75Y 210215 1.79-1.80； 9.56Y 240420 1.905-1.92。

|             | 1 y     | 3y      | 5y      | 7y      | 10y     |
|-------------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 昨日非国开金融债(%) | 1.4800  | 1.5700  | 1.6400  | 1.7700  | 1.9250  |
| 今日非国开金融债(%) | 1.4600  | 1.5400  | 1.6100  | 1.7600  | 1.9075  |
| 变动(%)       | -0.0200 | -0.0300 | -0.0300 | -0.0100 | -0.0175 |
| 昨日国开债(%)    | 1.5000  | 1.5650  | 1.6050  | 1.7725  | 1.9075  |
| 今日国开债(%)    | 1.4800  | 1.5450  | 1.5650  | 1.7650  | 1.9000  |
| 变动(%)       | -0.0200 | -0.0200 | -0.0400 | -0.0075 | -0.0075 |

短期融资券

今日银行间短融市场交投较活跃，成交主要集中于 2025Q1、Q2 期限。短端方面，7D 012483121 24 国家能源 SCP016 AAA 在 1.90%成交（估值+5 位置），银行出给基金；78D 012481713 24 浙交投 SCP010 AAA 在 1.80%成交（估值+2 位置），银行出给基金。中长端方面，109D 012482044 24 国盛 SCP005 AAA 在 1.78%成交（估值位置），基金出给理财；159D 042480379 24 电网 CP012 AAA 在 1.74%成交（估值 -1 位置），银行出给理财。长端方面，210D 042480353 24 一汽租赁 CP008 AAA 在 1.86%成交（估值位置），银行出给基金；253D 012483737 24 巨石 SCP008 AAA 在 1.84%成交（估值-1 位置），基金出给基金。总体而言，短端收益率日内小幅上行，中长端、长端收益日内均略微下行。

|               | 评级  | 1M   |   | 3M   |    | 6M   |    | 9M   |    | 12M  |    |
|---------------|-----|------|---|------|----|------|----|------|----|------|----|
| 绝对收益率         | AAA | 1.86 |   | 1.8  |    | 1.78 |    | 1.8  |    | 1.78 |    |
|               | AA+ | 1.95 |   | 1.82 |    | 1.81 |    | 1.82 |    | 1.85 |    |
|               | AA  | 1.92 |   | 1.9  |    | 1.91 |    | 1.87 |    | 1.88 |    |
|               | AA- | 2.0  |   | 1.95 |    | 1.98 |    | 2.0  |    | 2.0  |    |
| 与昨日收益变动对照（BP） | AAA | 1.81 | 5 | 1.78 | 2  | 1.78 | 0  | 1.79 | 1  | 1.79 | -1 |
|               | AA+ | 1.87 | 8 | 1.89 | -7 | 1.88 | -7 | 1.85 | -3 | 1.9  | -5 |
|               | AA  | 1.84 | 8 | 1.88 | 2  | 1.88 | 3  | 1.9  | -3 | 1.9  | -2 |
|               | AA- | 1.95 | 5 | 1.97 | -2 | 2.0  | -2 | 2.02 | -2 | 2.05 | -5 |

中期票据

今日中票交投情绪较为平淡，1-3 年短端中票，23 亦庄投资 MTN001(科创票据)（AAA，1.24Y）在 1.89%低估值 0.1bp 位置成交；21 浙能源 MTN002（AAA，1.34Y）在 1.77%低估值 2bp 成交；23 皖交控 MTN001（AAA，1.36Y）在 1.80%高估值 1bp 位置成交；3 到 5 年期限，23 临港控股 MTN002（AAA，3.89Y）在 2.09%低估值 0.5bp 位置成交；24 汇金 MTN001（AAA，4.29Y）成交在 1.98%低估值 1bp 位置；24 北排水 MTN002（AAA，4.70Y）成交在 2.03%低估值 2.5bp 位置。5Y 及以上期限，24 洛阳国晟 MTN001（AAA，9.60Y）在 3.14%，低估值 8bp 成交；24 石家城发 MTN002（AAA，9.77Y）成交在 2.42%，估值位置成交。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+ | 1.83 |   | 1.86 |    | 2    |    | 2.18 |      | None |      |
|               | AAA  | 1.9  |   | 1.99 |    | 2.16 |    | None |      | None |      |
|               | AA+  | 2.03 |   | 2.16 |    | 2.42 |    | None |      | None |      |
|               | AA   | 2.19 |   | 2.28 |    | 2.75 |    | None |      | None |      |
| 与昨日收益变动对照（BP） | AAA+ | 1.8  | 3 | 1.88 | -2 | 2.01 | -1 | 2.18 | 0    | None | None |
|               | AAA  | 1.88 | 2 | 2    | -1 | 2.17 | -1 | None | None | None | None |
|               | AA+  | 2.01 | 2 | 2.17 | -1 | 2.42 | 0  | None | None | None | None |
|               | AA   | 2.17 | 2 | 2.28 | 0  | 2.75 | 0  | None | None | None | None |

企业债

今日企业债成交活跃，基金，券商，理财，银行，券商资管均有参与。可质押方面，20 义乌 02 AAA 成交在 1.85%，银行理财卖出，基金买入。23 深业 01 AAA 成交在 1.95%，基金卖出，保险买入。24 蛇口 03 AAA 成交在 2.13%，基金卖出，基金买入。城投方面，20 天轨 03 AAA 成交在 1.91%，券商资管卖出，券商买入。23 枣阳 01 AA 成交在 2.20%，券商资管卖出，券商资管买入。24 柯建 03 AA 成交在 2.50%。长端方面，24 铁 YK08 AAA 成交在 2.28%。24 中关 04 AAA 成交在 2.36%。24 赣投 K2 AAA 成交在 2.39%。

银行债

今日银行债成交较为活跃，全天成交极为活跃，各期限均换手充分，长端尤为活跃。5Y 大行二级早盘买卖较为均衡，早盘成交在估值到估值-1 附近，午后开盘买盘情绪逐渐回落，市场在估值-0.5 到估值-1 小幅区间震荡成交，后又出现小幅 tkn 行情，最终收盘于估值-1.5，24 工行二级资本债 02BC（4.88Y）上午在 2.045(估值-1)、2.04(估值-1)均有成交，午后开盘分别成交在 2.04（估值-1），保险和基金出给银行和券商。3Y 附近，早盘成交在估值，随后全天平稳成交在估值-0.5 附近，双边均为券商和基金保险。短端成交尚可，全天成交在估值 0.5 至估值+0.5，基金、理财和券商出给理财和基金和理财。商金方面，成交多在估值+0.5 估值+2 之间，双边均为基金和银行。

美元债

周四市场配置情绪转好。投资级方面，拉久期买盘增加，买盘集中在央企、租赁等名字，但供给稀少，外资名字出现少量获利了结卖盘。城投板块，高性价比名字需求转好，供给持续被消化后。地产板块情绪转好，瑞安上涨 0.5-1pt，龙湖上涨 0.25-0.5pt，万科、万达整体持平至下跌 0.1pt。

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（%） |
|-----------|--------------|---------------------|-----|--------|
| 12D       | 012481136.IB | 24 青岛海控 SCP002      | AAA | 1.96   |
| 14D       | 012482605.IB | 24 苏交通 SCP019       | AAA | 1.95   |
| 27D       | 072410002.IB | 24 国信证券 CP001       | AAA | 1.85   |
| 36D       | 072410020.IB | 24 国信证券 CP003       | AAA | 1.85   |
| 40D       | 012483145.IB | 24 厦门航空 SCP006      | AAA | 1.85   |
| 40D       | 012483145.IB | 24 厦门航空 SCP006      | AAA | 1.85   |
| 89D       | 012481849.IB | 24 常州投资 SCP002      | AAA | 1.89   |
| 89D       | 012481849.IB | 24 常州投资 SCP002      | AAA | 1.89   |
| 89D       | 012481849.IB | 24 常州投资 SCP002      | AAA | 1.89   |
| 92D       | 012481860.IB | 24 中航租赁 SCP004      | AAA | 100    |
| 92D       | 012481860.IB | 24 中航租赁 SCP004      | AAA | 100    |
| 94D(休 1)  | 012481899.IB | 24 深特发 SCP001       | AA+ | 1.87   |
| 101D(休 1) | 012481977.IB | 24 常州投资 SCP003      | AAA | 1.9    |
| 101D(休 1) | 012481977.IB | 24 常州投资 SCP003      | AAA | 1.9    |
| 127D      | 012482314.IB | 24 京水投 SCP002       | AA+ | 1.9    |
| 149D(休 2) | 012482407.IB | 24 津渤海 SCP010       | AAA | 2.15   |
| 174D      | 012483847.IB | 24 桂能源股 SCP001      | AA+ | 2.4    |
| 187D      | 012483181.IB | 24 平安租赁 SCP014      | AAA | 1.91   |
| 191D(休 2) | 042480317.IB | 24 宁河西 CP002        | AAA | 1.86   |
| 195D      | 042480320.IB | 24 中国平煤 CP002       | AAA | 1.93   |
| 195D      | 042480320.IB | 24 中国平煤 CP002       | AAA | 1.93   |
| 195D      | 042480325.IB | 24 武汉城建 CP001       | AAA | 1.84   |
| 232D      | 012483799.IB | 24 核风电 SCP002(科创票据) | AAA | 1.78   |
| 233D(休 2) | 012483500.IB | 24 义乌国资 SCP003      | AAA | 1.88   |
| 241D(休 1) | 012483564.IB | 24 招金 SCP006        | AAA | 1.85   |
| 253D      | 012483737.IB | 24 巨石 SCP008        | AAA | 1.84   |

|           |              |                |     |      |
|-----------|--------------|----------------|-----|------|
| 258D      | 042480439.IB | 24 大兴发展 CP002  | AAA | 1.86 |
| 260D      | 012483863.IB | 24 环球租赁 SCP013 | AAA | 1.95 |
| 260D      | 012483863.IB | 24 环球租赁 SCP013 | AAA | 1.95 |
| 275D(休 2) | 042480465.IB | 24 高淳建设 CP011  | AA  | 2.01 |
| 289D(休 2) | 042480504.IB | 24 高淳建设 CP013  | AA  | 2.01 |
| 345D(休 2) | 042480581.IB | 24 邮政 CP003    | AAA | 1.78 |

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（%） |
|--------------|--------------|----------------------|--------|--------|
| 5D           | 102103283.IB | 21 邮政 MTN007         | AAA    | 1.97   |
| 8D           | 102180084.IB | 21 环球租赁 MTN003       | AAA    | 1.9    |
| 23D(休 2)     | 102103360.IB | 21 陕煤化 MTN012        | AAA    | 2.13   |
| 23D(休 2)     | 102103360.IB | 21 陕煤化 MTN012        | AAA    | 2.1    |
| 32D          | 102280069.IB | 22 徐州新盛 MTN002       | AAA    | 1.92   |
| 36D+3Y       | 102380116.IB | 23 新郑投资 MTN001       | AA+    | 1.98   |
| 67D+NY       | 102380219.IB | 23 洪山国投 MTN002       | AA+    | 2.1    |
| 74D          | 102280347.IB | 22 浙小商 MTN001        | AAA    | 1.85   |
| 74D          | 102000155.IB | 20 青岛国信 MTN002       | AAA    | 1.92   |
| 80D+2Y       | 102280400.IB | 22 华发 MTN003         | AAA    | 1.89   |
| 91D          | 102380478.IB | 23 中原资产 MTN001       | AAA    | 1.95   |
| 102D+1Y      | 102380667.IB | 23 嘉定新城 MTN001       | AA+    | 1.9    |
| 103D         | 102000478.IB | 20 萧山国资 MTN001       | AAA    | 1.84   |
| 133D+1Y      | 102381004.IB | 23 株洲城建 MTN002       | AA+    | 2.05   |
| 137D         | 102281015.IB | 22 浙交投 MTN002        | AAA    | 1.77   |
| 147D         | 102000957.IB | 20 甬开投 MTN001        | AAA    | 1.84   |
| 149D(休 2)    | 102281076.IB | 22 苏州高技 MTN002       | AAA    | 1.95   |
| 149D(休 2)    | 102281076.IB | 22 苏州高技 MTN002       | AAA    | 1.95   |
| 150D+2Y      | 102281069.IB | 22 九江城发 MTN001       | AAA    | 1.89   |
| 159D         | 132280049.IB | 22 雅砻江 GN002(碳中和债)   | AAA    | 1.8    |
| 165D+NY      | 102281126.IB | 22 陕西交通 MTN002A      | AAA    | 1.94   |
| 178D(休 1)    | 102381335.IB | 23 平安租赁 MTN001       | AAA    | 1.92   |
| 199D+2Y      | 102281435.IB | 22 驻马店投 MTN001       | AA+    | 2.03   |
| 214D+NY      | 102281555.IB | 22 华阳新材 MTN013       | AAA    | 2.05   |
| 214D+NY      | 102281555.IB | 22 华阳新材 MTN013       | AAA    | 2.05   |
| 226D(休 2)    | 102281635.IB | 22 苏国信 MTN004        | AAA    | 1.83   |
| 226D(休 2)    | 102281635.IB | 22 苏国信 MTN004        | AAA    | 1.83   |
| 227D(休 1)    | 102281650.IB | 22 浙国贸 MTN004        | AAA    | 1.9    |
| 232D+NY      | 102281681.IB | 22 大唐发电 MTN006       | AAA    | 1.9    |
| 240D(休 2)    | 102281736.IB | 22 苏国信 MTN005        | AAA    | 1.8    |
| 246D+2Y(休 1) | 102281798.IB | 22 株洲云龙 MTN002       | AA/AA+ | 2.16   |
| 250D+2Y      | 102281858.IB | 22 浙商资产 MTN002       | AAA    | 1.9    |
| 252D         | 102001586.IB | 20 宁沪高 MTN001        | AAA    | 1.79   |
| 267D         | 102282028.IB | 22 北方企业 MTN002       | AA+    | 1.92   |
| 288D+NY      | 102282155.IB | 22 江阴临港 MTN002       | AA+    | 2.23   |
| 288D+NY      | 102282155.IB | 22 江阴临港 MTN002       | AA+    | 2.23   |
| 291D+2Y      | 102200225.IB | 22 蔡甸城建 MTN001       | AA     | 2.07   |
| 304D+NY(休 1) | 102282224.IB | 22 中铁建 MTN001        | AAA    | 1.9    |
| 305D+2Y      | 102282231.IB | 22 金阳新城 MTN003       | AA+    | 1.99   |
| 316D+2Y(休 1) | 102282328.IB | 22 青岛海控 MTN001       | AAA    | 1.91   |
| 327D+NY      | 102282470.IB | 22 中电建设 MTN001       | AAA    | 1.91   |
| 327D+NY      | 102282470.IB | 22 中电建设 MTN001       | AAA    | 1.91   |
| 333D         | 102383026.IB | 23 瀚蓝 MTN001         | AA+    | 1.87   |
| 1.2Y         | 102380287.IB | 23 常熟发投 MTN001       | AA+    | 1.9    |
| 1.24Y(休 1)   | 102380418.IB | 23 亦庄投资 MTN001(科创票据) | AAA    | 1.89   |

|               |              |                      |     |       |
|---------------|--------------|----------------------|-----|-------|
| 1.33Y(休 1)    | 102380822.IB | 23 中国电子 MTN001(科创票据) | AAA | 1.81  |
| 1.33Y(休 1)    | 102380822.IB | 23 中国电子 MTN001(科创票据) | AAA | 1.81  |
| 1.34Y         | 102100675.IB | 21 浙能源 MTN002        | AAA | 1.77  |
| 1.34Y         | 102100675.IB | 21 浙能源 MTN002        | AAA | 1.77  |
| 1.36Y         | 102381001.IB | 23 皖交控 MTN001        | AAA | 1.8   |
| 1.36Y+NY      | 102380984.IB | 23 水利十四 MTN001       | AA+ | 2.09  |
| 1.43Y         | 102381188.IB | 23 丰台国资 MTN001       | AAA | 1.89  |
| 1.45Y(休 1)    | 102381220.IB | 23 深圳高速 MTN001       | AAA | 1.82  |
| 1.48Y+NY(休 1) | 102381322.IB | 23 大唐集 MTN004        | AAA | 1.92  |
| 1.68Y+NY      | 102382115.IB | 23 华润 MTN003         | AAA | 1.93  |
| 1.7Y          | 102101652.IB | 21 常交通 MTN002        | AA+ | 1.98  |
| 1.72Y         | 102101753.IB | 21 青岛城投 MTN004       | AAA | 1.96  |
| 1.72Y         | 102300449.IB | 23 邢台交建 MTN001       | AA+ | 2.14  |
| 1.72Y         | 102300449.IB | 23 邢台交建 MTN001       | AA+ | 2.14  |
| 1.85Y+NY      | 102382783.IB | 23 中电投 MTN044B       | AAA | 1.92  |
| 2.1Y          | 102480221.IB | 24 皖投集 MTN001        | AAA | 1.92  |
| 2.1Y          | 102480221.IB | 24 皖投集 MTN001        | AAA | 1.92  |
| 2.1Y          | 102480221.IB | 24 皖投集 MTN001        | AAA | 1.92  |
| 2.12Y+2Y      | 102400601.IB | 24 邢台交建 MTN001       | AA+ | 2.18  |
| 2.14Y+2Y      | 102480425.IB | 24 长沙经开 MTN001       | AA+ | 2.03  |
| 2.2Y          | 102480525.IB | 24 中交城投 MTN001       | AAA | 2.01  |
| 2.53Y         | 102482716.IB | 24 汇金 MTN004         | AAA | 1.84  |
| 2.53Y+NY      | 102400830.IB | 24 晋能煤业 MTN009       | AAA | 2.3   |
| 2.65Y(休 2)    | 102483376.IB | 24 光明房产 MTN005       | AA+ | 2.7   |
| 2.73Y+NY      | 102282057.IB | 22 鄂交投 MTN003B       | AAA | 2.075 |
| 2.73Y+NY      | 102282057.IB | 22 鄂交投 MTN003B       | AAA | 2.075 |
| 2.75Y+NY(休 2) | 102484035.IB | 24 京能国际 MTN003(BC)   | AAA | 2.34  |
| 2.75Y+NY(休 2) | 102484035.IB | 24 京能国际 MTN003(BC)   | AAA | 2.34  |
| 2.94Y+NY      | 102484977.IB | 24 中电投 MTN026        | AAA | 2.03  |
| 2.98Y+NY(休 2) | 102485248.IB | 24 中建方程 MTN001       | AA+ | 2.3   |
| 3.89Y         | 102382957.IB | 23 临港控股 MTN002       | AAA | 2.09  |
| 3.89Y         | 102382957.IB | 23 临港控股 MTN002       | AAA | 2.09  |
| 4.29Y         | 102481294.IB | 24 汇金 MTN001         | AAA | 1.98  |
| 4.29Y         | 102481294.IB | 24 汇金 MTN001         | AAA | 1.98  |
| 4.44Y(休 1)    | 102400754.IB | 24 邯郸交投 MTN002       | AA+ | 2.58  |
| 4.63Y         | 102483261.IB | 24 汇金 MTN005         | AAA | 1.985 |
| 4.7Y(休 1)     | 102483757.IB | 24 北排水 MTN002        | AAA | 2.03  |
| 4.71Y         | 102483849.IB | 24 金桥集团 MTN002A      | AAA | 2.08  |
| 4.95Y         | 102485075.IB | 24 陕延油 MTN013        | AAA | 2.04  |
| 9.6Y          | 102483067.IB | 24 洛阳国晟 MTN001       | AAA | 3.14  |
| 9.77Y         | 102484158.IB | 24 石家城发 MTN002       | AAA | 2.42  |

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（%） |
|-----------|-----------|------------|-----|--------|
| 5D        | 185141.SH | 21 石化 01   | AAA | 1.85   |
| 15D       | 149760.SZ | 21 东财 05   | AAA | 1.7    |
| 33D       | 163117.SH | 20 义乌 02   | AAA | 1.85   |
| 33D+2Y    | 185244.SH | 22 莞建 01   | AAA | 1.9    |
| 37D(休 2)  | 185287.SH | 22 银河 C2   | AAA | 1.87   |
| 66D(休 1)  | 185341.SH | 22 财通 G1   | AAA | 1.78   |
| 89D+NY    | 166204.SH | 20 国君 Y1   | AAA | 1.84   |
| 101D(休 1) | 162986.SH | 20 乳山 01   | AA  | 3.02   |
| 121D(休 2) | 115205.SH | 23 宁证 01   | AAA | 1.76   |
| 126D      | 115251.SH | 23 招证 G1   | AAA | 1.73   |

|               |              |                  |        |      |
|---------------|--------------|------------------|--------|------|
| 130D+NY       | 185703.SH    | 22 建材 Y3         | AAA    | 1.91 |
| 164D(休 1)     | 185814.SH    | 22 国君 G5         | AAA    | 1.75 |
| 187D          | 185894.SH    | 22 安租 13         | AAA    | 1.95 |
| 187D          | 185894.SH    | 22 安租 13         | AAA    | 1.95 |
| 192D(休 1)     | 241754.SH    | 24 招 S26         | AAA    | 1.75 |
| 193D+2Y       | 194134.SH    | 22 德源 02         | AA+    | 2.05 |
| 215D          | 149989.SZ    | 22 广发 01         | AAA    | 1.76 |
| 219D(休 2)     | 194811.SH    | 22 开元 01         | AA     | 2.27 |
| 233D+2Y       | 182348.SH    | 22 外资 01         | AAA    | 1.92 |
| 236D          | 148013.SZ    | 22 一创 03         | AAA    | 1.77 |
| 237D          | 152530.SH    | 20 天轨 03         | AAA    | 1.91 |
| 237D          | 152530.SH    | 20 天轨 03         | AAA    | 1.91 |
| 261D(休 2)     | 182579.SH    | 22 咸高 01         | AA     | 2.36 |
| 280D+2Y(休 2)  | 175166.SH    | 20 赣铁 01         | AAA    | 1.86 |
| 282D(休 2)     | 149950.SZ    | 22 中海 05         | AAA    | 1.96 |
| 306D          | 137904.SH    | 22 海通 06         | AAA    | 1.73 |
| 330D          | 256358.SH    | 24 成经 D3         | AA+    | 2.12 |
| 336D          | 175409.SH    | 20 华泰 C1         | AAA    | 1.78 |
| 340D          | 240241.SH    | 23 财券 G5         | AAA    | 1.75 |
| 344D+1Y(休 2)  | 253118.SH    | 23 世博 02         | AAA    | 1.88 |
| 1.02Y(休 2)    | 138743.SH    | 22 信投 G7         | AAA    | 1.75 |
| 1.02Y(休 2)    | 138743.SH    | 22 信投 G7         | AAA    | 1.75 |
| 1.09Y         | 240468.SH    | 24 方正 G1         | AAA    | 1.89 |
| 1.18Y         | 138865.SH    | 23 芜建 01         | AAA    | 1.93 |
| 1.36Y         | 148264.SZ    | 23 深业 01         | AAA    | 1.95 |
| 1.37Y         | 250763.SH    | 23 吴城 F2         | AA+    | 2.01 |
| 1.45Y+2Y      | 115396.SH    | 23 西城 02         | AAA    | 1.88 |
| 1.47Y+4Y(休 2) | 270028.SH    | 23 枣阳 01         | AA/AAA | 2.2  |
| 1.47Y+4Y(休 2) | 270028.SH    | 23 枣阳 01         | AA/AAA | 2.2  |
| 1.47Y+4Y(休 2) | 270028.SH    | 23 枣阳 01         | AA/AAA | 2.2  |
| 1.48Y+2Y      | 115442.SH    | 23 广越 05         | AAA    | 1.89 |
| 1.5Y+2Y       | 115478.SH    | 23 穗建 05         | AAA    | 1.93 |
| 1.64Y+2Y      | 152975.SH    | 21 杭实 01         | AAA    | 1.9  |
| 1.66Y         | 148417.SZ    | 23 中航 K1         | AAA    | 1.86 |
| 2.02Y(休 1)    | 240428.SH    | 23 苏信 03         | AAA    | 1.82 |
| 2.07Y+2Y      | 253431.SH    | 24 惠控 01         | AA+    | 2.07 |
| 2.1Y+2Y       | 253714.SH    | 24 柳州 01         | AA+    | 3.06 |
| 2.2Y+NY       | 092280003.IB | 22 中国信达债 01      | AAA    | 2.2  |
| 2.35Y         | 240710.SH    | 24 德泰 01         | AA+    | 2.6  |
| 2.35Y         | 240710.SH    | 24 德泰 01         | AA+    | 2.6  |
| 2.35Y+NY      | 185697.SH    | 22 招证 Y2         | AAA    | 2.05 |
| 2.37Y         | 152470.SH    | G20 滨江           | AA/AAA | 2.14 |
| 2.38Y         | 148730.SZ    | 24 运通 01         | AAA    | 1.96 |
| 2.38Y         | 148730.SZ    | 24 运通 01         | AAA    | 1.96 |
| 2.42Y+2Y      | 240996.SH    | 24 紫金 K1         | AAA    | 1.89 |
| 2.48Y         | 149938.SZ    | 22 蛇口 02         | AAA    | 2.13 |
| 2.7Y          | 182509.SH    | 22 嘉高 06         | AA+    | 2.05 |
| 2.73Y(休 1)    | 148900.SZ    | 24 蛇口 03         | AAA    | 2.13 |
| 2.88Y         | 256317.SH    | 24 青上 05         | AAA    | 2.37 |
| 4.37Y         | 091900007.IB | 19 长城债 02BC(品种二) | AAA    | 2.55 |
| 4.59Y(休 1)    | 255318.SH    | 24 望经 03         | AA+    | 2.35 |
| 4.61Y+5Y(休 2) | 255272.SH    | 24 平湖 04         | AA+    | 2.3  |
| 4.61Y+5Y(休 2) | 255272.SH    | 24 平湖 04         | AA+    | 2.3  |
| 4.61Y+5Y(休 2) | 255272.SH    | 24 平湖 04         | AA+    | 2.3  |
| 4.73Y         | 255743.SH    | 24 启东 F2         | AA+    | 2.32 |

|               |              |                          |         |       |
|---------------|--------------|--------------------------|---------|-------|
| 4.85Y         | 241758.SH    | 24 银河 G2                 | AAA     | 1.94  |
| 4.95Y(休 1)    | 256604.SH    | 24 拱国 03                 | AAA     | 2.17  |
| 4.97Y(休 1)    | 524050.SZ    | 24 鞍钢集 K6                | AAA     | 2.18  |
| 4.98Y+NY      | 282480011.IB | 24 平安人寿永续债 01            | AAA     | 2.24  |
| 9.23Y         | 240660.SH    | 24 建工 K1                 | AAA     | 2.39  |
| 126D+1Y       | 032380352.IB | 23 胶州湾 PPN001B           | AA+     | 2.21  |
| 191D+3Y       | 032380583.IB | 23 上饶创新 PPN001           | AA+/AAA | 2.34  |
| 227D(休 1)     | 032280671.IB | 22 金隆控股 PPN001           | AA+     | 2.2   |
| 227D(休 1)     | 032280671.IB | 22 金隆控股 PPN001           | AA+     | 2.2   |
| 227D(休 1)     | 032280671.IB | 22 金隆控股 PPN001           | AA+     | 2.2   |
| 320D          | 032281013.IB | 22 万州经开 PPN005(科创票<br>据) | AA+     | 2.25  |
| 1.74Y         | 032380837.IB | 23 淄博财金 PPN002(科创票<br>据) | AA+     | 2.3   |
| 1.87Y+2Y      | 032381021.IB | 23 南阳投资 PPN001           | AA+     | 2.26  |
| 1.98Y(休 1)    | 032381119.IB | 23 悦达 PPN003             | AAA     | 2.32  |
| 2.26Y+2Y(休 1) | 032480263.IB | 24 湖州产投 PPN001(科创票<br>据) | AAA     | 2.22  |
| 2.94Y+2Y      | 032400973.IB | 24 绍兴柯桥 PPN001           | AA+     | 2.15  |
| 4.5Y          | 032400779.IB | 24 上饶投资 PPN001           | AAA     | 2.67  |
| 11D           | 2120116.IB   | 21 南京银行 01               | AAA     | 1.8   |
| 96D+NY        | 2028006.IB   | 20 邮储银行永续债               | AAA     | 1.81  |
| 137D          | 2228028.IB   | 22 中信银行 01               | AAA     | 1.7   |
| 145D+5Y       | 2028013.IB   | 20 农业银行二级 01             | AAA     | 1.81  |
| 145D+5Y       | 2028013.IB   | 20 农业银行二级 01             | AAA     | 1.82  |
| 145D+5Y       | 2028013.IB   | 20 农业银行二级 01             | AAA     | 1.82  |
| 151D+NY       | 2028017.IB   | 20 农业银行永续债 01            | AAA     | 1.83  |
| 151D+NY       | 2028017.IB   | 20 农业银行永续债 01            | AAA     | 1.825 |
| 151D+NY       | 2028017.IB   | 20 农业银行永续债 01            | AAA     | 1.825 |
| 151D+NY       | 2028017.IB   | 20 农业银行永续债 01            | AAA     | 1.82  |
| 151D+NY       | 2028017.IB   | 20 农业银行永续债 01            | AAA     | 1.825 |
| 160D+5Y       | 2028018.IB   | 20 交通银行二级                | AAA     | 1.815 |
| 160D+5Y       | 2028018.IB   | 20 交通银行二级                | AAA     | 1.815 |
| 160D+5Y       | 2028018.IB   | 20 交通银行二级                | AAA     | 1.815 |
| 160D+5Y       | 2028018.IB   | 20 交通银行二级                | AAA     | 1.82  |
| 160D+5Y       | 2028018.IB   | 20 交通银行二级                | AAA     | 1.82  |
| 160D+5Y       | 2028018.IB   | 20 交通银行二级                | AAA     | 1.82  |
| 164D(休 1)     | 2228032.IB   | 22 建设银行绿色金融债 01          | AAA     | 1.45  |
| 238D+5Y       | 2020043.IB   | 20 苏州银行二级                | AAA/AA+ | 1.87  |
| 276D+5Y(休 2)  | 2028033.IB   | 20 建设银行二级                | AAA     | 1.815 |
| 283D+5Y(休 2)  | 2028038.IB   | 20 中国银行二级 01             | AAA     | 1.815 |
| 286D+5Y       | 2028041.IB   | 20 工商银行二级 01             | AAA     | 1.82  |
| 286D+5Y       | 2028041.IB   | 20 工商银行二级 01             | AAA     | 1.82  |
| 286D+5Y       | 2028041.IB   | 20 工商银行二级 01             | AAA     | 1.82  |
| 290D+5Y(休 2)  | 2020065.IB   | 20 徽商银行二级 01             | AAA     | 1.87  |
| 290D+5Y(休 2)  | 2020065.IB   | 20 徽商银行二级 01             | AAA     | 1.87  |
| 312D          | 2228050.IB   | 22 光大银行                  | AAA     | 1.7   |
| 339D+5Y(休 2)  | 2028049.IB   | 20 工商银行二级 02             | AAA     | 1.82  |
| 339D+5Y(休 2)  | 2028049.IB   | 20 工商银行二级 02             | AAA     | 1.825 |
| 340D+NY       | 2028048.IB   | 20 中国银行永续债 02            | AAA     | 1.82  |
| 1.11Y+5Y      | 2128002.IB   | 21 工商银行二级 01             | AAA     | 1.82  |
| 1.11Y+5Y      | 2128002.IB   | 21 工商银行二级 01             | AAA     | 1.82  |
| 1.11Y+5Y      | 2128002.IB   | 21 工商银行二级 01             | AAA     | 1.815 |
| 1.27Y+5Y      | 2128008.IB   | 21 中国银行二级 01             | AAA     | 1.83  |
| 1.27Y+5Y      | 2128008.IB   | 21 中国银行二级 01             | AAA     | 1.83  |
| 1.33Y         | 2328009.IB   | 23 中信银行 01               | AAA     | 1.7   |

|               |              |               |         |       |
|---------------|--------------|---------------|---------|-------|
| 1.33Y         | 2328009.IB   | 23 中信银行 01    | AAA     | 1.7   |
| 1.43Y         | 212380005.IB | 23 光大银行债 01   | AAA     | 1.71  |
| 1.43Y         | 2321014.IB   | 23 张家港农商三农债   | AA+     | 1.9   |
| 1.43Y+NY      | 2128019.IB   | 21 中国银行永续债 01 | AAA     | 1.85  |
| 1.49Y+NY      | 2128021.IB   | 21 工商银行永续债 01 | AAA     | 1.855 |
| 1.49Y+NY      | 2128022.IB   | 21 交通银行永续债    | AAA     | 1.85  |
| 1.49Y+NY      | 2128022.IB   | 21 交通银行永续债    | AAA     | 1.85  |
| 1.49Y+NY      | 2128022.IB   | 21 交通银行永续债    | AAA     | 1.85  |
| 1.49Y+NY      | 2128022.IB   | 21 交通银行永续债    | AAA     | 1.85  |
| 1.6Y(休 2)     | 212380007.IB | 23 上海银行小微债 01 | AAA     | 1.75  |
| 1.6Y(休 2)     | 212380007.IB | 23 上海银行小微债 01 | AAA     | 1.75  |
| 1.6Y          | 212380008.IB | 23 交行债 01     | AAA     | 1.715 |
| 1.64Y+NY(休 1) | 210316.IB    | 21 进出 16      | --/--   | 1.835 |
| 1.64Y+NY(休 1) | 210316.IB    | 21 进出 16      | --/--   | 1.83  |
| 1.64Y+NY(休 1) | 210316.IB    | 21 进出 16      | --/--   | 1.83  |
| 1.64Y+NY(休 1) | 210316.IB    | 21 进出 16      | --/--   | 1.84  |
| 1.64Y+NY(休 1) | 210316.IB    | 21 进出 16      | --/--   | 1.84  |
| 1.66Y+5Y(休 1) | 2128025.IB   | 21 建设银行二级 01  | AAA     | 1.86  |
| 1.66Y+5Y(休 1) | 2128025.IB   | 21 建设银行二级 01  | AAA     | 1.855 |
| 1.66Y+5Y(休 1) | 2128025.IB   | 21 建设银行二级 01  | AAA     | 1.855 |
| 1.66Y+5Y(休 1) | 2128025.IB   | 21 建设银行二级 01  | AAA     | 1.855 |
| 1.66Y+5Y(休 1) | 2128025.IB   | 21 建设银行二级 01  | AAA     | 1.855 |
| 1.7Y+5Y(休 2)  | 2128028.IB   | 21 邮储银行二级 01  | AAA     | 1.87  |
| 1.7Y+5Y(休 2)  | 2128028.IB   | 21 邮储银行二级 01  | AAA     | 1.87  |
| 1.7Y+5Y(休 2)  | 2128028.IB   | 21 邮储银行二级 01  | AAA     | 1.865 |
| 1.76Y+5Y(休 1) | 2120080.IB   | 21 齐鲁银行二级 01  | AAA/AA+ | 1.97  |
| 1.76Y+5Y(休 1) | 2120080.IB   | 21 齐鲁银行二级 01  | AAA/AA+ | 1.97  |
| 1.79Y(休 2)    | 212380021.IB | 23 交行债 02     | AAA     | 1.72  |
| 1.79Y(休 2)    | 212380021.IB | 23 交行债 02     | AAA     | 1.72  |
| 1.79Y+5Y(休 2) | 2128030.IB   | 21 交通银行二级     | AAA     | 1.87  |
| 1.79Y+5Y(休 2) | 2128030.IB   | 21 交通银行二级     | AAA     | 1.86  |
| 1.87Y+5Y(休 2) | 2128032.IB   | 21 兴业银行二级 01  | AAA     | 1.92  |
| 1.93Y+NY      | 2128038.IB   | 21 农业银行永续债 01 | AAA     | 1.895 |
| 1.93Y+5Y(休 1) | 2128039.IB   | 21 中国银行二级 03  | AAA     | 1.885 |
| 1.93Y+5Y(休 1) | 2128039.IB   | 21 中国银行二级 03  | AAA     | 1.885 |
| 1.93Y+5Y(休 1) | 2128039.IB   | 21 中国银行二级 03  | AAA     | 1.885 |
| 1.93Y+NY      | 2128038.IB   | 21 农业银行永续债 01 | AAA     | 1.89  |
| 1.96Y+NY      | 2128044.IB   | 21 工商银行永续债 02 | AAA     | 1.895 |
| 1.96Y+NY      | 2128044.IB   | 21 工商银行永续债 02 | AAA     | 1.9   |
| 1.96Y+NY(休 1) | 2128045.IB   | 21 中国银行永续债 02 | AAA     | 1.9   |
| 1.99Y+NY      | 2128047.IB   | 21 招商银行永续债    | AAA     | 1.91  |
| 2.01Y+5Y      | 2128051.IB   | 21 工商银行二级 02  | AAA     | 1.89  |
| 2.01Y+5Y      | 2128051.IB   | 21 工商银行二级 02  | AAA     | 1.885 |
| 2.01Y+5Y      | 2128051.IB   | 21 工商银行二级 02  | AAA     | 1.89  |
| 2.09Y+5Y      | 2228003.IB   | 22 兴业银行二级 01  | AAA     | 1.94  |
| 2.09Y+5Y      | 2228003.IB   | 22 兴业银行二级 01  | AAA     | 1.94  |
| 2.09Y+5Y      | 2228003.IB   | 22 兴业银行二级 01  | AAA     | 1.94  |
| 2.09Y+5Y      | 2228003.IB   | 22 兴业银行二级 01  | AAA     | 1.94  |
| 2.11Y+5Y      | 2228004.IB   | 22 工商银行二级 01  | AAA     | 1.89  |
| 2.12Y+5Y(休 2) | 2228006.IB   | 22 中国银行二级 01  | AAA     | 1.89  |
| 2.12Y+5Y(休 2) | 2228006.IB   | 22 中国银行二级 01  | AAA     | 1.89  |
| 2.12Y+5Y(休 2) | 2228006.IB   | 22 中国银行二级 01  | AAA     | 1.89  |
| 2.22Y         | 212380032.IB | 24 浦发银行债 01   | AAA     | 1.76  |
| 2.27Y         | 2420011.IB   | 24 浙商银行小微债 01 | AAA     | 1.79  |
| 2.27Y(休 1)    | 2420013.IB   | 24 北京银行 01    | AAA     | 1.79  |

|               |              |                         |       |        |
|---------------|--------------|-------------------------|-------|--------|
| 2.34Y+5Y      | 2228024.IB   | 22 工商银行二级 03            | AAA   | 1.91   |
| 2.34Y+5Y      | 2228024.IB   | 22 工商银行二级 03            | AAA   | 1.91   |
| 2.38Y+NY      | 2228029.IB   | 22 中国银行永续债 02           | AAA   | 1.93   |
| 2.38Y+NY      | 2228029.IB   | 22 中国银行永续债 02           | AAA   | 1.93   |
| 2.43Y+1Y      | 312400001.IB | 24 工行 TLAC 非资本债 01A     | AAA   | 1.91   |
| 2.51Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01            | AAA   | 1.915  |
| 2.51Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01            | AAA   | 1.915  |
| 2.51Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01            | AAA   | 1.92   |
| 2.51Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01            | AAA   | 1.92   |
| 2.51Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01            | AAA   | 1.92   |
| 2.51Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01            | AAA   | 1.92   |
| 2.51Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01            | AAA   | 1.93   |
| 2.51Y+5Y      | 2228039.IB   | 22 建设银行二级 01            | AAA   | 1.93   |
| 2.54Y(休 2)    | 2420028.IB   | 24 重庆银行小微债 01           | AAA   | 1.85   |
| 2.69Y+5Y(休 1) | 092280065.IB | 22 工行二级资本债 03A          | AAA   | 1.94   |
| 2.71Y         | 2420039.IB   | 24 广州银行小微债 01           | AAA   | 1.87   |
| 2.71Y         | 2420039.IB   | 24 广州银行小微债 01           | AAA   | 1.87   |
| 2.72Y+1Y      | 312410005.IB | 24 农行 TLAC 非资本债 01A(BC) | AAA   | 1.93   |
| 2.73Y+NY(休 1) | 092280086.IB | 22 农行永续债 02             | AAA   | 1.945  |
| 2.73Y+NY(休 1) | 092280086.IB | 22 农行永续债 02             | AAA   | 1.95   |
| 2.77Y(休 2)    | 2420042.IB   | 24 齐鲁银行小微债              | AAA   | 1.875  |
| 2.77Y(休 2)    | 2420042.IB   | 24 齐鲁银行小微债              | AAA   | 1.875  |
| 2.78Y+5Y      | 092200008.IB | 22 农行二级资本债 02A          | AAA   | 1.93   |
| 2.79Y(休 1)    | 212480057.IB | 24 湖南银行小微债 01           | AAA   | 1.94   |
| 2.8Y+5Y       | 092280098.IB | 22 杭州银行二级资本债 01         | AAA   | 1.99   |
| 2.87Y+5Y      | 092280108.IB | 22 中行二级资本债 02A          | AAA   | 1.94   |
| 2.95Y         | 2420052.IB   | 24 赣州银行小微债              | AA+   | 2.07   |
| 2.96Y+1Y      | 312410008.IB | 24 交行 TLAC 非资本债 01(BC)  | AAA   | 1.94   |
| 2.96Y+1Y      | 312410008.IB | 24 交行 TLAC 非资本债 01(BC)  | AAA   | 1.94   |
| 3.6Y+NY       | 242380013.IB | 23 建行永续债 01             | AAA   | 2.015  |
| 3.6Y+NY       | 242380013.IB | 23 建行永续债 01             | AAA   | 2.015  |
| 3.78Y+5Y      | 232380057.IB | 23 中行二级资本债 02A          | AAA   | 2.015  |
| 3.85Y+NY      | 242380019.IB | 23 邮储永续债 01             | AAA   | 2.04   |
| 3.86Y+5Y(休 1) | 232380066.IB | 23 中行二级资本债 03A          | AAA   | 2.0175 |
| 3.86Y+5Y(休 1) | 232380066.IB | 23 中行二级资本债 03A          | AAA   | 2.015  |
| 3.87Y+5Y      | 09230205.IB  | 23 国开行二级资本债 01A         | --/-- | 1.97   |
| 3.89Y+5Y      | 232380073.IB | 23 农行二级资本债 03A          | AAA   | 2.015  |
| 4.05Y+5Y      | 092303005.IB | 23 口行二级资本债 02A          | --/-- | 1.96   |
| 4.14Y+5Y      | 232480001.IB | 24 中行二级资本债 01A          | AAA   | 2.02   |
| 4.15Y+5Y      | 232480004.IB | 24 农行二级资本债 01A          | AAA   | 2.025  |
| 4.15Y+5Y      | 232480004.IB | 24 农行二级资本债 01A          | AAA   | 2.025  |
| 4.26Y+NY(休 1) | 242400004.IB | 24 邮储永续债 01             | AAA   | 2.065  |
| 4.26Y+NY(休 1) | 242400004.IB | 24 邮储永续债 01             | AAA   | 2.065  |
| 4.27Y+5Y(休 1) | 1928003.IB   | 19 农业银行二级 01            | AAA   | 2.04   |
| 4.36Y+NY      | 242480002.IB | 24 兴业银行永续债 01           | AAA   | 2.11   |
| 4.36Y+NY      | 242480002.IB | 24 兴业银行永续债 01           | AAA   | 2.11   |
| 4.44Y+5Y      | 232480020.IB | 24 兴业银行二级资本债 01         | AAA   | 2.09   |
| 4.47Y+NY(休 1) | 242400008.IB | 24 江苏银行永续债 01           | AAA   | 2.155  |
| 4.48Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02             | AAA   | 2.095  |
| 4.48Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02             | AAA   | 2.095  |
| 4.48Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02             | AAA   | 2.095  |
| 4.48Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02             | AAA   | 2.095  |
| 4.48Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02             | AAA   | 2.09   |
| 4.48Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02             | AAA   | 2.09   |

|               |              |                  |     |        |
|---------------|--------------|------------------|-----|--------|
| 4.48Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02      | AAA | 2.09   |
| 4.48Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02      | AAA | 2.09   |
| 4.48Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02      | AAA | 2.09   |
| 4.48Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02      | AAA | 2.08   |
| 4.5Y+NY       | 242480004.IB | 24 华夏银行永续债 01    | AAA | 2.16   |
| 4.5Y+NY       | 242480004.IB | 24 华夏银行永续债 01    | AAA | 2.17   |
| 4.5Y+NY       | 242480004.IB | 24 华夏银行永续债 01    | AAA | 2.17   |
| 4.5Y+NY       | 242480004.IB | 24 华夏银行永续债 01    | AAA | 2.16   |
| 4.57Y+5Y(休 2) | 232480033.IB | 24 建行二级资本债 02A   | AAA | 2.03   |
| 4.57Y+5Y(休 2) | 232480033.IB | 24 建行二级资本债 02A   | AAA | 2.04   |
| 4.57Y+5Y(休 2) | 232480033.IB | 24 建行二级资本债 02A   | AAA | 2.04   |
| 4.57Y+5Y(休 2) | 232480033.IB | 24 建行二级资本债 02A   | AAA | 2.05   |
| 4.57Y+5Y(休 2) | 232480033.IB | 24 建行二级资本债 02A   | AAA | 2.04   |
| 4.57Y+5Y(休 2) | 232480033.IB | 24 建行二级资本债 02A   | AAA | 2.035  |
| 4.58Y+5Y      | 232480032.IB | 24 兴业银行二级资本债 02  | AAA | 2.1    |
| 4.58Y+5Y      | 232480035.IB | 24 平安银行二级资本债 01A | AAA | 2.1325 |
| 4.58Y+5Y      | 232480035.IB | 24 平安银行二级资本债 01A | AAA | 2.13   |
| 4.58Y+5Y      | 232480035.IB | 24 平安银行二级资本债 01A | AAA | 2.125  |
| 4.58Y+5Y      | 232480035.IB | 24 平安银行二级资本债 01A | AAA | 2.125  |
| 4.58Y+5Y      | 232480035.IB | 24 平安银行二级资本债 01A | AAA | 2.125  |
| 4.58Y+5Y      | 232480035.IB | 24 平安银行二级资本债 01A | AAA | 2.13   |
| 4.58Y+NY      | 242480007.IB | 24 工行永续债 01      | AAA | 2.09   |
| 4.58Y+NY      | 242480007.IB | 24 工行永续债 01      | AAA | 2.09   |
| 4.58Y+NY      | 242480007.IB | 24 工行永续债 01      | AAA | 2.09   |
| 4.62Y+5Y      | 232480037.IB | 24 交行二级资本债 02A   | AAA | 2.05   |
| 4.63Y+NY      | 242480008.IB | 24 中行永续债 01      | AAA | 2.09   |
| 4.65Y+5Y(休 2) | 232480039.IB | 24 广发银行二级资本债 01A | AAA | 2.13   |
| 4.65Y+5Y(休 2) | 232400032.IB | 24 成都银行二级资本债 02  | AAA | 2.21   |
| 4.65Y+5Y(休 2) | 232400032.IB | 24 成都银行二级资本债 02  | AAA | 2.21   |
| 4.65Y+5Y      | 232480050.IB | 24 上海银行二级资本债 01  | AAA | 2.14   |
| 4.67Y+5Y(休 2) | 232400034.IB | 24 杭州银行二级资本债 01  | AAA | 2.11   |
| 4.67Y+5Y(休 2) | 232400034.IB | 24 杭州银行二级资本债 01  | AAA | 2.11   |
| 4.67Y+5Y(休 2) | 232400034.IB | 24 杭州银行二级资本债 01  | AAA | 2.11   |
| 4.67Y+5Y(休 2) | 232400034.IB | 24 杭州银行二级资本债 01  | AAA | 2.11   |
| 4.67Y+5Y(休 2) | 232400034.IB | 24 杭州银行二级资本债 01  | AAA | 2.11   |
| 4.68Y+5Y      | 1928020.IB   | 19 交通银行二级 02     | AAA | 2.04   |
| 4.68Y+5Y      | 232480052.IB | 24 浦发银行二级资本债 01A | AAA | 2.095  |
| 4.68Y+5Y      | 232480052.IB | 24 浦发银行二级资本债 01A | AAA | 2.09   |
| 4.68Y+5Y      | 232480052.IB | 24 浦发银行二级资本债 01A | AAA | 2.09   |
| 4.68Y+5Y      | 232480052.IB | 24 浦发银行二级资本债 01A | AAA | 2.09   |
| 4.68Y+5Y      | 232480052.IB | 24 浦发银行二级资本债 01A | AAA | 2.09   |
| 4.68Y+5Y      | 232480052.IB | 24 浦发银行二级资本债 01A | AAA | 2.0925 |
| 4.68Y+5Y      | 232480052.IB | 24 浦发银行二级资本债 01A | AAA | 2.0925 |
| 4.68Y+5Y      | 232480052.IB | 24 浦发银行二级资本债 01A | AAA | 2.0925 |
| 4.7Y+5Y       | 232400035.IB | 24 南京银行二级资本债 01  | AAA | 2.14   |
| 4.7Y+5Y       | 232400036.IB | 24 南京银行二级资本债 02  | AAA | 2.14   |
| 4.7Y+5Y       | 232400035.IB | 24 南京银行二级资本债 01  | AAA | 2.135  |
| 4.7Y+NY(休 1)  | 242400019.IB | 24 江苏银行永续债 02    | AAA | 2.175  |
| 4.7Y+NY(休 1)  | 242400019.IB | 24 江苏银行永续债 02    | AAA | 2.17   |
| 4.71Y+NY      | 242400020.IB | 24 交行永续债 01BC    | AAA | 2.1    |
| 4.71Y+NY      | 242400020.IB | 24 交行永续债 01BC    | AAA | 2.1075 |
| 4.71Y+NY      | 242400020.IB | 24 交行永续债 01BC    | AAA | 2.095  |
| 4.71Y+NY      | 242400020.IB | 24 交行永续债 01BC    | AAA | 2.095  |
| 4.71Y+NY      | 242400020.IB | 24 交行永续债 01BC    | AAA | 2.095  |
| 4.71Y+NY      | 242400020.IB | 24 交行永续债 01BC    | AAA | 2.1    |

|               |              |                    |     |        |
|---------------|--------------|--------------------|-----|--------|
| 4.71Y+5Y      | 232480061.IB | 24 工行二级资本债 01A(BC) | AAA | 2.04   |
| 4.71Y+5Y      | 232480061.IB | 24 工行二级资本债 01A(BC) | AAA | 2.04   |
| 4.71Y+5Y      | 232480061.IB | 24 工行二级资本债 01A(BC) | AAA | 2.04   |
| 4.71Y+5Y      | 232480061.IB | 24 工行二级资本债 01A(BC) | AAA | 2.04   |
| 4.73Y+NY      | 242400022.IB | 24 成都农商行永续债 01     | AAA | 2.3    |
| 4.73Y+NY      | 242400022.IB | 24 成都农商行永续债 01     | AAA | 2.3    |
| 4.79Y+NY      | 232480067.IB | 24 华夏银行永续债 02      | AAA | 2.17   |
| 4.79Y+NY      | 232480067.IB | 24 华夏银行永续债 02      | AAA | 2.17   |
| 4.79Y+NY      | 232480067.IB | 24 华夏银行永续债 02      | AAA | 2.175  |
| 4.88Y+5Y(休 2) | 232480073.IB | 24 工行二级资本债 02BC    | AAA | 2.04   |
| 4.88Y+5Y(休 2) | 232480073.IB | 24 工行二级资本债 02BC    | AAA | 2.04   |
| 4.88Y+5Y(休 2) | 232480073.IB | 24 工行二级资本债 02BC    | AAA | 2.04   |
| 4.88Y+5Y(休 2) | 232480073.IB | 24 工行二级资本债 02BC    | AAA | 2.04   |
| 4.88Y+5Y(休 2) | 232480073.IB | 24 工行二级资本债 02BC    | AAA | 2.045  |
| 4.9Y+NY       | 242480070.IB | 24 招行永续债 01BC      | AAA | 2.135  |
| 4.9Y+NY       | 242480070.IB | 24 招行永续债 01BC      | AAA | 2.135  |
| 4.9Y+NY       | 242480070.IB | 24 招行永续债 01BC      | AAA | 2.135  |
| 4.9Y+NY       | 242480070.IB | 24 招行永续债 01BC      | AAA | 2.135  |
| 4.9Y+NY       | 242480070.IB | 24 招行永续债 01BC      | AAA | 2.135  |
| 4.9Y+NY       | 242400031.IB | 24 平安银行永续债 01      | AAA | 2.23   |
| 4.9Y+NY       | 242400031.IB | 24 平安银行永续债 01      | AAA | 2.235  |
| 4.9Y+NY       | 242400031.IB | 24 平安银行永续债 01      | AAA | 2.235  |
| 4.9Y+NY       | 242400031.IB | 24 平安银行永续债 01      | AAA | 2.23   |
| 4.9Y+NY       | 242400031.IB | 24 平安银行永续债 01      | AAA | 2.23   |
| 4.95Y+NY(休 1) | 242400033.IB | 24 广发银行永续债 02      | AAA | 2.19   |
| 4.96Y+NY      | 242480082.IB | 24 农行永续债 03BC      | AAA | 2.1175 |
| 4.96Y+NY      | 242480082.IB | 24 农行永续债 03BC      | AAA | 2.1225 |
| 4.96Y+NY      | 242480082.IB | 24 农行永续债 03BC      | AAA | 2.11   |
| 4.99Y+5Y(休 1) | 232480098.IB | 24 浦发银行二级资本债 02A   | AAA | 2.105  |
| 4.99Y+NY      | 242480086.IB | 24 中行永续债 02BC      | AAA | 2.1125 |
| 4.99Y+NY      | 242480086.IB | 24 中行永续债 02BC      | AAA | 2.1125 |
| 4.99Y+NY      | 242480086.IB | 24 中行永续债 02BC      | AAA | 2.1125 |
| 4.99Y+5Y(休 1) | 232480098.IB | 24 浦发银行二级资本债 02A   | AAA | 2.115  |
| 4.99Y+5Y(休 1) | 232480098.IB | 24 浦发银行二级资本债 02A   | AAA | 2.1075 |
| 4.99Y+5Y(休 1) | 232480098.IB | 24 浦发银行二级资本债 02A   | AAA | 2.1075 |
| 4.99Y+5Y(休 1) | 232480098.IB | 24 浦发银行二级资本债 02A   | AAA | 2.1075 |
| 4.99Y+5Y(休 1) | 232480098.IB | 24 浦发银行二级资本债 02A   | AAA | 2.1075 |
| 4.99Y+5Y(休 1) | 232480098.IB | 24 浦发银行二级资本债 02A   | AAA | 2.11   |
| 4.99Y+5Y(休 1) | 232480098.IB | 24 浦发银行二级资本债 02A   | AAA | 2.105  |
| 4.99Y+5Y(休 1) | 232480098.IB | 24 浦发银行二级资本债 02A   | AAA | 2.105  |
| 4.99Y+NY      | 242480086.IB | 24 中行永续债 02BC      | AAA | 2.11   |
| 4.99Y+NY      | 242480086.IB | 24 中行永续债 02BC      | AAA | 2.11   |
| 4.99Y+5Y(休 1) | 232480098.IB | 24 浦发银行二级资本债 02A   | AAA | 2.1    |
| 4.99Y+NY      | 242480086.IB | 24 中行永续债 02BC      | AAA | 2.11   |
| 4.99Y+NY      | 242480086.IB | 24 中行永续债 02BC      | AAA | 2.115  |
| 5.76Y+5Y      | 2028035.IB   | 20 浦发银行二级 04       | AAA | 2.17   |
| 5.76Y+5Y      | 2028035.IB   | 20 浦发银行二级 04       | AAA | 2.17   |
| 6.66Y+5Y(休 1) | 2128026.IB   | 21 建设银行二级 02       | AAA | 2.17   |
| 9.14Y+5Y      | 232480002.IB | 24 中行二级资本债 01B     | AAA | 2.19   |
| 9.14Y+5Y      | 232480002.IB | 24 中行二级资本债 01B     | AAA | 2.19   |
| 9.99Y+5Y(休 2) | 232480099.IB | 24 浦发银行二级资本债 02B   | AAA | 2.29   |

联系人: Xiaoting Bu  
邮箱: [Xiaoting.Bu@cfets-nex.com.cn](mailto:Xiaoting.Bu@cfets-nex.com.cn)