



【2024-10-15】

国债

央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，10月15日以固定利率、数量招标方式开展了683亿元7天期逆回购操作，操作利率1.50%。Wind数据显示，当日417亿元逆回购到期。Wind数据显示，本周央行公开市场将有3469亿元逆回购到期，其中周二至周五分别到期417亿元、610亿元、1500亿元、942亿元。此外，周四和周五分别有700亿元和900亿元国库现金定存到期；周三有7890亿元MLF到期。

国债方面 283D 240015 1.44-1.445； 2.83Y 240016 1.635-1.64； 4.75Y 240014 1.7825-1.80； 6.69Y 240013 1.99-2.025； 9.61Y 240011 2.11-2.135； 29Y 230023 2.2725-2.315。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.4425	1.6050	1.7925	2.0200	2.1310	2.2975
今日国债(%)	1.4425	1.6100	1.7825	1.9900	2.1100	2.2875
变动(%)	0.0000	0.0050	-0.0100	-0.0300	-0.0210	-0.0100

金融债

金融债方面 283D 240421 1.68-1.69； 4.36Y 240203 1.85-1.88； 6.01Y 200215 2.04-2.05； 9.72Y 240420 2.22-2.2375。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.6875	1.8025	1.9050	2.1700	2.2350
今日非国开金融债(%)	1.6800	1.8000	1.9000	2.1700	2.2200
变动(%)	-0.0075	-0.0025	-0.0050	0.0000	-0.0150
昨日国开债(%)	1.6800	1.7800	1.8700	2.0950	2.2190
今日国开债(%)	1.6850	1.7750	1.8475	2.0800	2.1950
变动(%)	0.0050	-0.0050	-0.0225	-0.0150	-0.0240

短期融资券

今日银行间短融市场交投较为活跃，基成交主要集中在2024年Q4期限。短端方面，15D 012480958.IB 24国网租赁SCP006 AAA在2.00%成交（估值-13位置），券商出给券商；45D 012480669.IB 24扬州交通SCP002 AA+在2.20%成交（估值-2位置），银行出给基金；中长端方面，119D 012481594.IB 24光大集团SCP002 AAA在2.04%成交（估值-3位置），基金出给理财；177D 012482599.IB 24深业SCP002 AAA在2.16%成交（估值-1位置），基金出给基金；长端方面，251D 012483206.IB 24杭商贸SCP006 AAA在2.16%成交（估值-1位置），银行出给基金；309D 042480490.IB 24电网CP024 AAA在1.97%（估值-1位置），银行出给基金；短端和中长端收益率均有所下行。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	1.96		2		2.01		2.02		2.07	
	AA+	2.05		2.13		2.14		2.09		2.15	
	AA	2.08		2.13		2.15		2.15		2.16	
	AA-	2.17		2.19		2.19		2.24		2.4	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	1.98	-2	2.05	-5	2.05	-4	2.07	-5	2.1	-3
	AA+	2	5	2.05	8	2.12	2	2.07	2	2.16	-1
	AA	2.2	-12	2.15	-2	2.21	-6	2.23	-8	2.25	-9
	AA-	2.18	-1	2.25	-6	2.25	-6	2.38	-14	2.49	-9

中期票据

今日中票交投情绪平淡，1-3年短端中票，23悦达MTN002（AAA，1.03Y）在2.40%低估值5bp的位置成交；16武汉地铁MTN001（AAA，1.44Y）在2.24%低估值4.5bp位置成交；16国开投MTN001（AAA，1.74Y）在2.13%低估值1bp位置成交；3到5年期限，24云能投MTN013

(AAA, 3.64Y) 在 3.28%低估值 7bp 位置成交；24 南电 MTN002 (AAA, 4.37Y) 成交在 2.22%，低估值 2bp 的位置；24 长春公交 MTN002B (AAA, 4.49Y) 成交在 3.02%，低估 2bp 位置。5Y 及以上期限，24 三峡新能 MTN002 (AAA, 9.64Y) 在 2.52%低估值 4bp 的位置成交；24 渝高速 MTN005 (AAA, 9.85Y) 成交在 2.75%，低估值 6bp 的位置。总体而言，今日中票收益下行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.02		2.13		2.25		2.45		None	
	AAA	2.17		2.24		2.43		None		None	
	AA+	2.33		2.42		2.62		None		None	
	AA	2.45		2.56		2.97		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.07	-5	2.15	-2	2.26	-1	2.46	-1	None	None
	AAA	2.24	-7	2.26	-2	2.45	-2	None	None	None	None
	AA+	2.4	-7	2.45	-3	2.64	-2	None	None	None	None
	AA	2.49	-4	2.6	-4	3	-3	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，21 南网 04 AAA 成交在 2.25%，基金卖出，券商买入。21 金隅 01 AAA 成交在 2.40%，理财卖出，基金买入。19 电建 Y2 AAA 成交在 2.05%，保险卖出，券商买入。城投方面，20 甘交 G1 AAA 成交在 2.40%，券商卖出，券商买入。22 龙城 03 AAA 成交在 2.24%，基金卖出，银行买入。24 济源 D1 AA+ 成交在 2.65%，券商卖出，券商买入。长端方面，24 重发 03 AAA 成交在 2.78%。20 中信 02 AAA 成交在 2.28%。24 泉发 03 AAA 成交在 2.60%。

银行债

今日银行债市场成交相对活跃，日内震荡下行，各类机构均有参与。20 中信银行二级成交 2.06，基金券商和理财买基金。20 中国银行永续债 02 成交 2.08 位置，券商买基金。21 交通银行永续债成交 2.135 位置，基金买基金。21 工商银行永续债 02 成交 2.16 位置，理财买基金和券商。22 建设银行二级 01 成交 2.16 至 2.18 区间，基金买农商行。24 广发银行二级资本债 01A 成交 2.38 和 2.39 位置，基金和券商买基金。24 平安银行二级资本债 01B 成交在 2.6 位置，基金买基金。商金债方面，129D 22 光大银行小微债成交在 1.93 位置，基金买银行。2.61Y 24 交行债 01 成交 2.025 位置，基金买基金银行和券商。2.87Y 24 温州银行 01 成交 2.28 位置，基金买基金。

美元债

昨天美国假期无隔夜美债波动，市场交投较为清淡。投资级方面，金融板块投资者偏好收息资产，27 年到期招银租赁浮息债在 5.54%附近成交多笔，33 年到期中银航空租赁市场成交在 4.875%，创兴银行 25 年可赎回 AT1 在 5.81%位置被 Tkn。城投板块整体安静，高收益点心债方面，买盘集中在债务相对较低省份。地产板块延续涨势，新城、路劲、万科、龙湖等上涨 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
2D	012482211.IB	24 国能新能 SCP002	AAA	1.99%
2D	012482211.IB	24 国能新能 SCP002	AAA	1.99%
3D	012481605.IB	24 电网 SCP023	AAA	1.98%
3D	012481610.IB	24 电网 SCP024	AAA	1.95%
5D(休 1)	012480313.IB	24 鲁国资 SCP001	AAA	2.30%
10D	012482120.IB	24 长电 SCP002	AAA	1.90%
10D	012480622.IB	24 张江集 SCP001	AAA	2.00%
10D	012480622.IB	24 张江集 SCP001	AAA	2.00%
14D	012480447.IB	24 景国资 SCP001	AA+	2.48%
15D	012480958.IB	24 国网租赁 SCP006	AAA	2.00%
34D	012480555.IB	24 柳钢集团 SCP002(科创票据)	AAA	2.27%
34D	012480555.IB	24 柳钢集团 SCP002(科创票据)	AAA	2.27%
35D	012481345.IB	24 顺义国资 SCP001	AA+	2.20%
41D	012480654.IB	24 靖江城投 SCP001	AA	2.48%
45D	012480669.IB	24 扬州交通 SCP002	AA+	2.20%
57D	012481281.IB	24 中国水务 SCP001	AA+	2.15%
57D	042380734.IB	23 连云工投 CP002	AA	2.45%
76D	012482024.IB	24 兖矿能源 SCP001	AAA	2.10%
85D	012481454.IB	24 苏州港 SCP001	AA+	2.49%
87D	012482032.IB	24 苏州高新 SCP033	AAA	2.07%
93D	012482221.IB	24 天成租赁 SCP006	AAA	2.18%
94D	012481371.IB	24 陕延油 SCP004	AAA	2.01%
95D(休 2)	012400341.IB	24 津南城投 SCP002	AA+	2.70%
97D	012483250.IB	24 粤科金融 SCP002	AAA	2.13%
101D	012483003.IB	24 华侨城 SCP003	AAA	2.63%
102D(休 2)	012481522.IB	24 福清核电 SCP003	AAA	2.12%
102D(休 2)	012481522.IB	24 福清核电 SCP003	AAA	2.12%
102D(休 2)	012481522.IB	24 福清核电 SCP003	AAA	2.12%

108D(休 4)	042480062.IB	24 丹投 CP001	AA+	2.48%
123D(休 2)	012481609.IB	24 鄂长投 SCP003	AAA	2.14%
126D	012481659.IB	24 南京医药 SCP002	AA+	2.23%
140D	012481772.IB	24 伊犁财通 SCP003	AA+	2.24%
153D	012481910.IB	24 江西交投 SCP004	AAA	2.00%
177D	012482599.IB	24 深业 SCP002	AAA	2.16%
177D	012483038.IB	24 华电产融 SCP010	AAA	2.16%
178D	012483288.IB(10.16 上市)	24 天成租赁 SCP009	AAA	2.17%
182D	072410167.IB	24 南京证券 CP003	AAA	2.02%
182D	012482212.IB	24 福州古厝 SCP004	AAA	2.10%
250D(休 1)	012483193.IB	24 爱尔医疗 SCP002	AA+	2.50%
251D	012483206.IB	24 杭商贸 SCP006	AAA	2.16%
268D	042480353.IB	24 一汽租赁 CP008	AAA	2.23%
308D	042480483.IB	24 电网 CP020	AAA	1.97%
309D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.97%
309D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.97%
309D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.97%
309D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.97%
309D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.97%
309D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.97%
309D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.97%
309D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.97%
309D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA	1.97%

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
10D	102102121.IB	21 华电股 MTN005	AAA	1.93%
12D(休 1)	102102153.IB	21 北京国资 MTN001	AAA	2.00%
63D	102103281.IB	21 河钢集 MTN008	AAA	2.20%
83D	102280012.IB	22 溧水城建 MTN001	AA+	2.20%
87D	102280044.IB	22 华为 MTN001	AAA	2.02%
90D	102280072.IB	22 中建材 MTN001	AAA	2.02%
90D	102280072.IB	22 中建材 MTN001	AAA	2.02%
91D	102280101.IB	22 河钢集 MTN001	AAA	2.25%
101D	102280195.IB	22 东莞交投 MTN001	AAA	2.07%
129D	102000148.IB	20 紫金矿业 MTN001	AAA	2.03%
136D	102280384.IB	22 中建材 MTN002	AAA	2.02%
142D	102000258.IB	20 扬州经开 MTN001	AA/AA+	2.34%
142D	102000258.IB	20 扬州经开 MTN001	AA/AA+	2.34%
146D	102000283.IB	20 中建材集(疫情防控债)MTN001	AAA	2.02%
155D	102000415.IB	20 中国旅游 MTN002	AAA	2.02%
161D+2Y	102280609.IB	22 武侯资本 MTN001	AA+	2.23%
163D	102000521.IB	20 荆门城投 MTN001	AA	2.45%
182D	102280800.IB	22 光大集团 MTN001	AAA	2.00%
182D	102280800.IB	22 光大集团 MTN001	AAA	2.00%
185D	102280818.IB	22 沪港务 MTN001	AAA	2.00%
187D(休 1)	102000733.IB	20 豫高管 MTN002	AAA	2.12%
234D	102281196.IB	22 新长宁 MTN002	AAA	2.17%
235D(休 2)	102381323.IB	23 桂投资 MTN001	AAA	2.30%
273D	102281569.IB	22 江铜 MTN001	AAA	2.03%
342D+3Y	102382574.IB	23 迈瑞城投 MTN001	AA+	2.66%
345D+NY	102382593.IB	23 高淳经开 MTN001	AA	2.64%
364D	102282247.IB	22 晋焦煤 MTN002	AAA	2.10%
1Y+1Y	102382698.IB	23 洛阳城投 MTN001	AA+	2.32%
1.03Y(休 2)	102382849.IB	23 悦达 MTN002	AAA	2.40%
1.17Y	102002304.IB	20 柳州东投 MTN002	AA+	3.30%
1.4Y	102380461.IB	23 首开 MTN002	AAA	3.20%
1.41Y	102100422.IB	21 奉贤交通 MTN001	AA+	2.15%
1.44Y+NY	101674004.IB	16 武汉地铁 MTN001	AAA	2.24%
1.45Y(休 2)	102380711.IB	23 宿州城投 MTN002	AA+	2.43%
1.63Y	102381285.IB	23 灵山 MTN001	AA+	2.33%
1.65Y	102381336.IB	23 佛山地铁 MTN001	AAA	2.18%
1.67Y	102101084.IB	21 首创置业 MTN002	AAA	3.15%
1.74Y(休 2)	101652027.IB	16 国开投 MTN001	AAA	2.13%
1.8Y+2Y	102381914.IB	23 金融街 MTN004A	AAA	2.45%
1.82Y	102382015.IB	23 无锡城南 MTN001	AA+	2.33%
1.93Y+NY(休 1)	102382522.IB	23 中建三局 MTN001(科创票据)	AAA	2.40%
2.05Y+2Y	102382985.IB	23 富和建设 MTN004	AA	2.52%
2.06Y	102481598.IB	24 云能投 MTN009	AAA	2.73%
2.11Y	102103081.IB	21 淄博城资 MTN002	AAA	2.50%

2.16Y+2Y	102383322.IB	23 湖州经开 MTN003	AA+	2.50%
2.22Y	102400583.IB	24 潍坊城建 MTN001B	AAA	2.72%
2.25Y+1Y(休 2)	102480141.IB	24 南京新港 MTN001	AA+	2.45%
2.28Y	102480307.IB	24 淮北建投 MTN003	AA+	2.53%
2.31Y	102480438.IB	24 崇川国资 MTN001	AA+	2.33%
2.31Y(休 6)	102480487.IB	24 粤珠江 MTN001	AAA	3.00%
2.31Y(休 6)	102480487.IB	24 粤珠江 MTN001	AAA	3.00%
2.37Y(休 1)	102480612.IB	24 云建投 MTN004	AAA	2.99%
2.39Y	102480792.IB	24 芯鑫租赁 MTN001	AAA	2.40%
2.39Y	102480733.IB	24 格力 MTN002	AAA	2.32%
2.42Y	132480024.IB	24 融和融资 GN002(碳中和债)	AAA	2.32%
2.44Y+NY	102481128.IB	24 山西建投 MTN003A	AAA	3.00%
2.53Y(休 1)	102481747.IB	24 豫航空港 MTN007	AAA	2.70%
2.53Y	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA	2.10%
2.53Y	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA	2.10%
2.61Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	2.16%
2.61Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	2.16%
2.61Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	2.16%
2.61Y+NY	102482024.IB	24 鲁高速 MTN005	AAA	2.35%
2.61Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	2.16%
2.62Y(休 1)	102281151.IB	22 蜀道投资 MTN008(乡村振兴)	AAA	2.23%
2.63Y	102482129.IB	24 山东海运 MTN001	AAA	2.57%
2.64Y(休 2)	102482138.IB	24 吴中城投 MTN001	AA+	2.32%
2.64Y(休 2)	102482163.IB	24 邮政 MTN003	AAA	2.16%
2.64Y(休 1)	102482197.IB	24 昆明新都 MTN001	AA+	4.00%
2.66Y+2Y	102482230.IB	24 衡阳高新 MTN001	AA+	2.70%
2.66Y+2Y	102482230.IB	24 衡阳高新 MTN001	AA+	2.70%
2.66Y+2Y	102482230.IB	24 衡阳高新 MTN001	AA+	2.70%
2.66Y(休 1)	102400796.IB	24 太仓水务 MTN001	AA	2.52%
2.67Y+2Y	102482325.IB	24 孝感高创 MTN001	AA	2.75%
2.68Y+2Y	102482386.IB	24 威海城投 MTN002A	AA+	2.60%
2.72Y(休 1)	102482864.IB	24 华电煤业 MTN002	AAA	2.25%
2.73Y(休 2)	102482921.IB	24 建安投资 MTN002	AA+	2.55%
2.81Y+NY(休 1)	132480070.IB	24 乌江水电 GN001	AAA	2.53%
2.81Y+NY(休 1)	132480070.IB	24 乌江水电 GN001	AAA	2.53%
2.85Y(休 1)	102483702.IB	24 昆明轨道 MTN006	AAA	3.95%
2.85Y(休 1)	102483702.IB	24 昆明轨道 MTN006	AAA	3.95%
2.88Y	102483925.IB	24 中广核 MTN004(科创票据)	AAA	2.17%
2.88Y	102483925.IB	24 中广核 MTN004(科创票据)	AAA	2.17%
2.95Y+NY	102484328.IB	24 溧水经开 MTN005	AA+	2.85%
3.5Y	102380879.IB	23 普陀城投 MTN001	AA	2.46%
3.64Y	102482216.IB	24 云能投 MTN013	AAA	3.28%
3.76Y	102483111.IB	24 云能投 MTN016	AAA	3.28%
4.37Y	102480585.IB	24 南电 MTN002	AAA	2.22%
4.49Y	102481464.IB	24 长春公交 MTN002B	AAA	3.02%
4.49Y	102481464.IB	24 长春公交 MTN002B	AAA	3.02%
4.59Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.24%
4.62Y+5Y	102482089.IB	24 粤海 MTN001	AAA	2.26%
4.62Y+5Y	102482089.IB	24 粤海 MTN001	AAA	2.26%
4.64Y	102482171.IB	24 赣州城投 MTN003	AA+	2.70%
4.68Y	102482677.IB	24 铜陵建投 MTN002	AA	2.76%
4.68Y	102482697.IB	24 温江兴蓉 MTN002	AA+	2.71%
4.72Y	102482856.IB	24 越秀交通 MTN003	AAA	2.35%
4.72Y	102482856.IB	24 越秀交通 MTN003	AAA	2.35%
4.72Y	102482856.IB	24 越秀交通 MTN003	AAA	2.35%
4.73Y	102482955.IB	24 京能洁能 MTN001	AAA	2.30%
4.73Y	102482955.IB	24 京能洁能 MTN001	AAA	2.30%
4.75Y(休 1)	102400855.IB	24 合肥产投 MTN002A	AAA	2.57%
4.75Y	102483051.IB	24 厦国贸控 MTN010	AAA	2.80%
4.76Y	102483075.IB	24 泉州台集 MTN001B	AA+	2.80%
4.76Y	102483075.IB	24 泉州台集 MTN001B	AA+	2.80%
4.86Y(休 1)	102483757.IB	24 北排水 MTN002	AAA	2.30%
4.89Y	102483930.IB	24 路桥公投 MTN002	AA+	2.83%
9.64Y	102482181.IB	24 三峡新能 MTN002	AAA	2.52%
9.84Y+NY	102483552.IB	24 扬子国资 MTN001	AAA	3.00%
9.85Y	102483672.IB	24 渝高速 MTN005	AAA	2.75%
9.87Y	102483803.IB	24 蜀道投资 MTN012	AAA	2.77%
9.87Y	102483803.IB	24 蜀道投资 MTN012	AAA	2.77%
29.6Y	102481988.IB	24 铁道 MTN003B	AAA	2.395%

剩余天数	债券代码	债券代码（发行机构）	评级	收益率
6D	1922043.IB	19 工银投资债 04	AAA	2.01%
8D	252757.SH	23 恒业 D1	AA+	2.80%
11D(休 2)	188924.SH	21 南网 04	AAA	2.25%
19D(休 1)	197342.SH	21 红发 05	AA+	3.70%
24D+2Y(休 1)	152320.SH	19 西咸 02	AAA	100.8
38D+2Y(休 1)	185041.SH	21 金隅 01	AAA	2.40%
38D+NY	163956.SH	19 电建 Y2	AAA	2.05%
38D+NY	163956.SH	19 电建 Y2	AAA	2.05%
63D	162745.SH	19 惠投 03	AA+	2.25%
87D	138816.SH	23 华泰 G1	AAA	1.98%
87D	138816.SH	23 华泰 G1	AAA	1.98%
94D	149784.SZ	22 不动 01	AAA	99.35
98D	149787.SZ	22 深机 01	AAA	2.06%
126D	149801.SZ	22 天马 01	AAA	2.18%
137D(休 2)	194038.SH	22 泰通 01	AA/AA+	2.80%
152D(休 1)	133211.SZ	22 龙城 03	AAA	2.24%
154D+2Y	185471.SH	22 蓉产 01	AAA	2.14%
160D+5Y(休 1)	2023002.IB	20 中邮人寿	AAA	2.19%
161D	092280007.IB	22 长城金融债 01BC	AAA	2.18%
161D	254322.SH	24 济源 D1	AA+	3.00%
184D	250642.SH	23 广德 01	AA	2.68%
185D	185682.SH	G22 三资	AAA	2.05%
186D(休 2)	115260.SH	23 中证 G6	AAA	1.98%
189D+2Y	166593.SH	20 豫铁 01	AAA	2.28%
211D	2022020.IB	20 工银投资债 01	AAA	2.00%
211D	2022020.IB	20 工银投资债 01	AAA	2.00%
211D	2022020.IB	20 工银投资债 01	AAA	2.00%
217D	185778.SH	G22 长电 3	AAA	1.96%
217D	185778.SH	G22 长电 3	AAA	1.96%
229D(休 2)	163591.SH	20 常城 01	AAA	2.10%
249D(休 2)	251523.SH	23 泰控 01	AA/AA+	2.95%
267D	255210.SH	24 北港 D1	AAA	2.40%
267D	255210.SH	24 北港 D1	AAA	2.40%
286D	163764.SH	20 常城 03	AAA	2.10%
311D	137693.SH	22 光证 G3	AAA	2.02%
325D	137780.SH	22 华泰 G4	AAA	1.97%
325D	137780.SH	22 华泰 G4	AAA	1.97%
325D	137780.SH	22 华泰 G4	AAA	1.97%
335D	252378.SH	23 科城 K3	AA+	2.35%
346D	134040.SZ	24 知投 D2	AAA	2.27%
348D(休 1)	137863.SH	22 海晟 G2	AA+	2.42%
1.01Y	137932.SH	22 衢资 02	AA+	2.26%
1.03Y(休 2)	148101.SZ	22 深资 03	AAA	2.14%
1.07Y	163119.SH	20 甘交 G1	AAA	2.40%
1.1Y(休 2)	240300.SH	23 唐租 03	AAA	2.26%
1.13Y+1Y	197657.SH	21 冶高 02	AA/AA+	3.16%
1.29Y	175721.SH	21 华泰 C1	AAA	2.10%
1.38Y+2Y(休 2)	240632.SH	24 中金 G1	AAA	2.03%
1.38Y+2Y(休 2)	240632.SH	24 中金 G1	AAA	2.04%
1.43Y(休 1)	240723.SH	24 国保 01	AAA	2.32%
1.43Y(休 1)	240723.SH	24 国保 01	AAA	2.32%
1.53Y+NY(休 1)	188054.SH	21 中金 Y2	AAA	2.21%
1.53Y+2Y	250934.SH	23 柯经 01	AA/AA+	2.30%
1.59Y+NY(休 1)	188100.SH	21 信投 Y1	AAA	2.21%
1.59Y+NY(休 1)	188100.SH	21 信投 Y1	AAA	2.21%
1.65Y+5Y	2123010.IB	21 中信保诚人寿	AAA/AA+	2.34%
1.77Y	188393.SH	21 东莞 01	AA+	2.27%
1.92Y	188752.SH	21 中航 01	AAA	2.15%
1.92Y	188752.SH	21 中航 01	AAA	2.15%
1.94Y	136723.SH	16 石化 03	AAA	2.07%
1.94Y	136723.SH	16 石化 03	AAA	2.08%
1.95Y	188802.SH	21 穗建 05	AAA	2.22%
2.08Y	133705.SZ	23 通顺 01	AA+	2.62%
2.16Y	240402.SH	23CEE01	AAA	2.20%
2.26Y	133752.SZ	24 山东财金信融 01	AA/AAA	2.69%
2.26Y	133752.SZ	24 山东财金信融 01	AA/AAA	2.69%
2.26Y	133752.SZ	24 山东财金信融 01	AA/AAA	2.69%
2.52Y	148711.SZ	24 广发 06	AAA	2.15%
2.56Y	2080130.IB	20 扬州龙川债 02	AA+	2.43%

2.63Y+2Y	185827.SH	22 保利 04	AAA	2.64%
2.69Y+2Y(休 1)	255050.SH	24 饶创 04	AA+	3.30%
2.82Y+NY	137635.SH	22 建工 Y4	AAA	2.30%
2.91Y+2Y	255790.SH	24 天心 01	AA+	2.40%
2.91Y	2422052.IB	24 中银消费金融债 05	AAA	2.29%
2.95Y(休 2)	255953.SH	24 潍坊 07	AAA	2.72%
3.78Y	2180294.IB	21 金华融盛债 01	AA	2.66%
3.82Y	2180317.IB	21 宁乡专项 01	AA+/AAA	2.62%
3.99Y	184801.SH	23 铁道 19	AAA	2.12%
4.05Y	252870.SH	23 怀科 03	AA+	2.58%
4.05Y	252870.SH	23 怀科 03	AA+	2.58%
4.22Y	148563.SZ	24 福投 01	AAA	2.30%
4.39Y	240644.SH	24 海通 04	AAA	2.21%
4.39Y	240644.SH	24 海通 04	AAA	2.21%
4.43Y	240689.SH	24 甬城 02	AAA	2.33%
4.5Y	254581.SH	24 藏投 02	AA+	2.57%
4.5Y	254581.SH	24 藏投 02	AA+	2.57%
4.69Y(休 1)	254973.SH	24 泽州 02	AA	3.15%
4.73Y	241228.SH	24 兴城 06	AAA	2.37%
4.73Y	241228.SH	24 兴城 06	AAA	2.37%
4.78Y	155561.SH	19 国投 02	AAA	2.27%
4.78Y	155561.SH	19 国投 02	AAA	2.27%
4.78Y	255413.SH	24 中资 04	AAA	2.65%
4.94Y(休 1)	241605.SH	24 泉发 03	AAA	2.60%
5.37Y	163175.SH	20 中信 02	AAA	2.28%
9.79Y(休 2)	148833.SZ	24 重发 03	AAA	2.78%
22.03Y(休 2)	1680432.IB	16 铁道 08	AAA	2.40%
13D+2Y	032191176.IB	21 滨江投资 PPN005	AA+	2.57%
24D	032281026.IB	22 昆明土地 PPN002	AA+	4.50%
34D	032191304.IB	21 奉化农发 PPN001	AA	2.36%
35D	032180044.IB	21 张家城投 PPN001	AA+	2.15%
56D+2Y	032191421.IB	21 钱江投资 PPN001	AA/AA+	2.50%
63D	031900897.IB	19 淄博城运 PPN002	AAA	2.40%
152D+2Y	032280293.IB	22 南昌水投 PPN001	AAA	2.25%
155D	032000244.IB	20 江东控股 PPN001	AA+	2.30%
194D(休 1)	032280455.IB	22 余杭创新 PPN001	AAA	2.21%
194D(休 1)	032280455.IB	22 余杭创新 PPN001	AAA	2.21%
234D	032380519.IB	23 洛阳城乡 PPN004	AA+	2.44%
242D(休 2)	032280542.IB	22 合川投资 PPN002	AA	2.65%
255D	032280587.IB	22 伊犁财通 PPN001	AA+	2.40%
255D	032200211.IB	22 武汉车都 PPN002	AAA	2.27%
278D(休 1)	032000650.IB	20 邵阳城投 PPN002	AA+	2.55%
279D+1Y	032380677.IB	23 沛县城投 PPN006	AA	2.55%
314D	032280759.IB	22 日照能源 PPN001	AA+	2.50%
320D+1Y	032380823.IB	23 大足发展 PPN002	AA+	2.90%
325D	032480974.IB	24 淮安开发 PPN008	AA+	2.50%
338D+3Y	032380850.IB	23 衡高控股 PPN001	AA+	2.65%
347D+3Y	032380969.IB	23 衡高控股 PPN002	AA+	2.60%
1.3Y	032100186.IB	21 郸都国资 PPN001	AA	2.50%
1.3Y	032100186.IB	21 郸都国资 PPN001	AA	2.50%
2.18Y(休 2)	032381239.IB	23 三门峡 PPN003	AA+	2.68%
2.52Y(休 2)	032480423.IB	24 泰兴城投 PPN007	AA+	2.60%
2.62Y+2Y	032480488.IB	24 嵊州交通 PPN002	AA	2.63%
4.39Y	032480097.IB	24 宜昌城发 PPN001	AA+	2.58%
4.39Y	032480097.IB	24 宜昌城发 PPN001	AA+	2.58%
4.51Y	032480404.IB	24 宜昌城发 PPN003	AA+	2.52%
4.51Y	032480404.IB	24 宜昌城发 PPN003	AA+	2.52%
4.58Y(休 1)	032480473.IB	24 常德城投 PPN004	AA+	2.89%
4.58Y(休 1)	032480473.IB	24 常德城投 PPN004	AA+	2.89%
4.58Y(休 1)	032480473.IB	24 常德城投 PPN004	AA+	2.82%
4.58Y(休 1)	032480473.IB	24 常德城投 PPN004	AA+	2.82%
4.82Y	032480838.IB	24 龙城发展 PPN003B	AAA	2.67%
26D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	1.97%
26D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	1.97%
35D+NY	1920070.IB	19 台州银行永续债 01	AAA/AA+	2.15%
65D+5Y	190311.IB	19 进出 11	2.07%	
129D	2228009.IB	22 光大银行小微债	AAA	1.93%
150D	2220021.IB	22 成都银行绿色债	AAA	1.95%
168D+NY	2020016.IB	20 江苏银行永续债	AAA	2.07%
187D+NY(休 1)	2020020.IB	20 华融湘江永续债	AAA/AA+	2.30%
203D+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.05%
209D+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.06%

257D+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.17%
267D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.07%
267D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.08%
292D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.055%
292D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.055%
303D+5Y	2028024.IB	20 中信银行二级	AAA	2.06%
303D+5Y	2028024.IB	20 中信银行二级	AAA	2.06%
334D+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.05%
341D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.05%
342D+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.09%
342D+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.09%
1Y+NY	2028042.IB	20 兴业银行永续债	AAA	2.09%
1Y+NY	2028042.IB	20 兴业银行永续债	AAA	2.09%
1.01Y(休 1)	2228051.IB	22 平安银行小微债	AAA	1.98%
1.01Y	2228050.IB	22 光大银行	AAA	1.97%
1.02Y	2220071.IB	22 苏州银行小微债	AAA	2.01%
1.09Y+5Y(休 2)	2028049.IB	20 工商银行二级 02	AAA	2.06%
1.09Y+NY	2028048.IB	20 中国银行永续债 02	AAA	2.08%
1.09Y+NY	2028048.IB	20 中国银行永续债 02	AAA	2.08%
1.09Y+NY	2028048.IB	20 中国银行永续债 02	AAA	2.08%
1.09Y+NY	2028048.IB	20 中国银行永续债 02	AAA	2.08%
1.27Y+5Y	2128002.IB	21 工商银行二级 01	AAA	2.06%
1.44Y+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	2.11%
1.44Y+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	2.11%
1.53Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.14%
1.53Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.14%
1.59Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	2.13%
1.62Y(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	2.01%
1.65Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.125%
1.65Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.125%
1.65Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.14%
1.65Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.125%
1.65Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.135%
1.65Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.135%
1.65Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.14%
1.76Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.00%
1.86Y+NY	2121038.IB	21 重庆农商永续债	AAA	2.40%
1.95Y(休 3)	212380020.IB	23 光大银行债 02	AAA	2.02%
1.95Y(休 2)	212380021.IB	23 交行债 02	AAA	2.02%
1.95Y+5Y(休 2)	2128030.IB	21 交通银行二级	AAA	2.14%
1.95Y+5Y(休 2)	2128030.IB	21 交通银行二级	AAA	2.14%
1.95Y+5Y(休 2)	2128030.IB	21 交通银行二级	AAA	2.14%
1.95Y+5Y(休 2)	2128030.IB	21 交通银行二级	AAA	2.14%
2.01Y+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	2.22%
2.07Y+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	2.15%
2.09Y+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	2.15%
2.09Y+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	2.14%
2.11Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.18%
2.12Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.23%
2.12Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.23%
2.12Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	2.23%
2.12Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA	2.16%
2.12Y	212380027.IB	23 华夏银行债 05	AAA	2.03%
2.15Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	2.20%
2.15Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	2.21%
2.16Y+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	2.22%
2.27Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	2.15%
2.27Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	2.17%
2.28Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.15%
2.28Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.155%
2.36Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.19%
2.36Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.19%
2.38Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	2.03%
2.39Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.16%
2.45Y+5Y(休 1)	2220030.IB	22 重庆银行二级	AAA/AA+	2.36%
2.49Y(休 1)	212480009.IB	24 上海银行债 01	AAA	2.06%
2.59Y	212480011.IB	24 浙商银行小微债 03	AAA	2.07%
2.59Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.17%
2.61Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	2.0675%
2.61Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	2.03%
2.61Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	2.03%
2.61Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	2.03%

2.61Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	2.03%
2.61Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	2.03%
2.67Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.17%
2.67Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.175%
2.67Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.18%
2.67Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.18%
2.67Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.16%
2.74Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	2.04%
2.74Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	2.04%
2.8Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	2.25%
2.86Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	2.23%
2.86Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	2.23%
2.86Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	2.22%
2.87Y(休 1)	2420036.IB	24 温州银行 01	AAA	2.28%
2.87Y(休 1)	2420036.IB	24 温州银行 01	AAA	2.28%
2.88Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	2.23%
2.88Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	2.24%
2.89Y+NY(休 1)	092280086.IB	22 农行永续债 02	AAA	2.23%
2.96Y+5Y	092280098.IB	22 杭州银行二级资本债 01	AAA	2.25%
3.02Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	2.30%
3.02Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	2.31%
3.02Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	2.32%
3.07Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.18%
3.2Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.43%
3.2Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.43%
3.43Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	2.20%
3.43Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	2.22%
3.44Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	2.20%
3.62Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.31%
3.62Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.32%
3.76Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	2.30%
3.86Y+5Y	232380033.IB	23 成都银行二级资本债 01	AAA	2.45%
3.87Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.30%
4.02Y+5Y(休 1)	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A	AAA	2.27%
4.03Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	2.28%
4.03Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	2.28%
4.03Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	2.26%
4.12Y+5Y(休 1)	232380082.IB	23 浙商银行二级资本债 02	AAA	2.36%
4.12Y+5Y(休 1)	232380082.IB	23 浙商银行二级资本债 02	AAA	2.37%
4.17Y+5Y	232380088.IB	23 苏州银行二级 01	AAA/AA+	2.47%
4.18Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	2.32%
4.18Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	2.32%
4.3Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	2.27%
4.41Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.325%
4.41Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.325%
4.42Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.32%
4.42Y+5Y(休 1)	1928003.IB	19 农业银行二级 01	AAA	2.27%
4.49Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AAA	2.275%
4.49Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AAA	2.27%
4.53Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.275%
4.53Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.28%
4.53Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.39%
4.53Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.39%
4.53Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.40%
4.54Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.27%
4.54Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.28%
4.6Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.34%
4.63Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.43%
4.64Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.33%
4.65Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.43%
4.65Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.43%
4.65Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.43%
4.68Y+NY	242480005.IB	24 杭州银行永续债 01	AAA	2.42%
4.73Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.27%
4.73Y+5Y	232480032.IB	24 兴业银行二级资本债 02	AAA	2.34%
4.74Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.375%
4.74Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.39%
4.74Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.34%
4.78Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.295%
4.79Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.33%
4.79Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.34%
4.81Y+5Y(休 2)	232400032.IB	24 成都银行二级资本债 02	AAA	2.50%

4.81Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.39%
4.81Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.39%
4.81Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.38%
4.81Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.38%
4.81Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.38%
4.81Y+5Y	232480050.IB	24 上海银行二级资本债 01	AAA	2.38%
4.84Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.36%
4.84Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.38%
4.84Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.38%
4.84Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.37%
4.84Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.37%
4.84Y+NY(休 1)	242400016.IB	24 民生银行永续债 01	AAA	2.615%
4.87Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.275%
4.87Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.275%
4.87Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.28%
4.87Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.295%
4.89Y+NY	242400022.IB	24 成都农商行永续债 01	AAA	2.60%
4.91Y+NY	242400025.IB	24 北京银行永续债 01	AAA	2.45%
9.74Y+5Y	232480036.IB	24 平安银行二级资本债 01B	AAA	2.60%
9.74Y+5Y	232480036.IB	24 平安银行二级资本债 01B	AAA	2.60%
9.81Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA	2.57%

文 / Derek Huang, Liyuan Zhong, Austin Lin

联系人：Xiaoting Bu
邮箱：Xiaoting.Bu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明：
以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和／或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“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。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN

禁止处理涉密信息和内部敏感信息