



【2024-09-18】

国债

为维护银行体系流动性合理充裕，2024 年 9 月 18 日央行以固定利率、数量招标方式开展 5682 亿元 7 天期逆回购操作，操作利率 1.70%，与此前持平。今日有 4875 亿元逆回购到期。

国债方面 4.82Y 240014 1.685-1.70； 6.77Y 240013 1.89-1.905； 9.68Y 240011 2.03-2.05； 29.67Y 230023 2.16-2.1875。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.2900	1.4800	1.6900	1.9125	2.0650	2.2180
今日国债(%)	1.2900	1.4800	1.6700	1.8910	2.0400	2.1850
变动(%)	0.0000	0.0000	-0.0200	-0.0215	-0.0250	-0.0330

*今日部分代表券有调整，1Y 国债更新为 240015，3y 国债更新为 240010，5y 国债更新为 240008，7y 国债更新为 240013，10y 国债更新为 240011，30y 国债更新为 2400001

金融债

金融债方面 314D 240421 1.65-1.665； 4.57Y 240405 1.8725-1.875 ； 9.63Y 240210 2.12-2.1375。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.6500	1.7575	1.8600	1.9800	2.1450
今日非国开金融债(%)	1.6500	1.7650	1.8750	1.9800	2.1450
变动(%)	0.0000	0.0075	0.0150	0.0000	0.0000
昨日国开债(%)	1.6650	1.7800	1.8600	2.0000	2.1250
今日国开债(%)	1.6350	1.7550	1.8450	1.9825	2.1240
变动(%)	-0.0300	-0.0250	-0.0150	-0.0175	-0.0010

*今日部分代表券有调整，10y 国开更新为 240210

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 Q4 期限。短端方面，43D 012482375.IB 24 华能 SCP008 AAA 在 1.9748%成交（估值位置），银行出给银行；78D 012483008.IB 24 首旅 SCP007 AAA 在 2.03%成交（估值-2 位置），银行出给理财。中长端方面，112D 042480013.IB 24 云投 CP001 AAA 在 2.22%成交（估值+2 位置），基金出给基金；125D 012481533.IB 24 广州发展 SCP001 AAA 在 2.02%成交（估值位置），基金出给基金。长端方面，212D 012482265.IB 24 浙交投 SCP012 AAA 在 1.98%成交（估值位置），银行出给基金；242D(休 1) 012482492.IB 24 杭商贸 SCP004 AAA 在 2.07%成交，估值-1 位置，基金出给基金。总体而言，短端、中长端和长端收益均呈上行。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	2.02		1.95		2.0		2.05		2.01	
	AA+	2.01		2.03		2.02		2.05		2.08	
	AA	2.06		2.05		2.03		2.08		2.1	
	AA-	2.08		2.13		2.12		2.18		2.2	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	2.02	0	2.01	-6	2.0	0	2.05	0	2.01	0
	AA+	2.01	0	2.03	0	2.05	-3	2.06	-1	2.08	0

	AA	2.06	0	2.07	-2	2.09	-6	2.08	0	2.11	-1
	AA-	2.1	-2	2.13	0	2.13	-1	2.18	0	2.2	0

中期票据

今日中票交投情绪较为普通，1-3 年短端中票，22 鄂联投 MTN004（AAA，1.11Y）在 2.13%低估值 1bp 位置成交；24 湘高速 MTN013（AAA，1.99Y）在 2.13%低估值 1bp 位置成交；24 中电投 MTN020（AAA，2.94Y）在 2.06%低估值 1bp 位置成交；3 到 5 年期限，24 皖投集 MTN002B（AAA，4.47Y）在 2.23%低估值 1bp 位置成交；24 合肥产投 MTN002A（AAA，4.82Y）成交在 2.34%，估值位置。5Y 及以上期限，24 京国资 MTN001A（AAA，9.39Y）在 2.36%，低估值 1bp 位置成交；24 沪港务 MTN003（AAA，9.93Y）成交在 2.30%，高估值 1bp 位置成交。总体而言，今日中票收益在估值附近震荡。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.01		2.05		2.13		2.3		None	
	AAA	2.09		2.12		2.25		None		None	
	AA+	2.2		2.25		2.34		None		None	
	AA	2.29		2.33		2.71		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.01	0	2.04	1	2.13	0	2.3	0	None	None
	AAA	2.1	-1	2.12	0	2.25	0	None	None	None	None
	AA+	2.2	0	2.25	0	2.35	-1	None	None	None	None
	AA	2.28	1	2.32	1	2.7	1	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 建材 08 AAA 成交在 2.09%，券商资管卖出，基金买入。24 国管 01 AAA 成交在 2.09%，基金卖出，保险买入。24 川资 02 AAA 成交在 2.365%，银行卖出，理财买入。城投方面，18 湖州城投债 01 AAA 成交在 2.08%，建投卖出，基金买入。24 杭高新债 02 AAA 成交在 2.23%。24 商丘 02 AA+ 成交在 2.75%，券商卖出，理财买入。长端方面，23 国管 02 AAA 成交在 2.32%，保险卖出，保险买入。24 鲁信 01 AAA 成交在 2.53%，基金卖出，理财买入。24 洪轨 02 AAA 成交在 2.51%。

银行债

今日银行债成交较为一般，全天成交在估值-0.5 到估值+0.5，买卖盘较为均衡，收盘成交在估值。成交以 4-5Y 的大行二永为主。商金债成交主要分布于股份行和城商行。5Y 方面，大行二永早盘成交在估值附近，收益率盘中保持平稳。午后开盘，市场情绪继续平稳，买卖力量较为均衡，在估值到估值+0.5 范围内波动，后尾盘收益率收盘于估值。24 工行二级资本债 01A（4.96Y）今日在 2.145%（估值）随后一度行至 2.1375%（-0.5），收盘回到 2.145%（估值），券商出给券商和基金和理财。24 交行永续债 01BC（4.96Y）今日在 2.185%（-0.5）成交多笔，券商出给券商和理财。短端今日成交较为平淡，基金和券商出给基金。20 工商银行二级 01（1.03Y+5Y）在 2.01%（-1.5）成交多笔，保险出给基金。商金方面，今日成交较少，24 南京银行 01（2.69Y）成交活跃，成交在 1.98%（估值-0.5），基金，银行和券商参与双边。

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
3D(休 2)	012480890.IB	24 广州地铁 SCP003	AAA	3.2
6D	012482287.IB	24 广州港 SCP006	AAA	2.06
7D	012482563.IB	24 中化股 SCP002	AAA	1.96
7D	012482046.IB	24 伊利实业 SCP016	AAA	2.05
8D	012482055.IB	24 伊利实业 SCP017	AAA	2.05
9D	012480807.IB	24 湘高速 SCP002	AAA	2
9D	012480109.IB	24 海淀国资 SCP001	AAA	2.15
9D	012480109.IB	24 海淀国资 SCP001	AAA	2.15
9D	012480094.IB	24 苏城投 SCP001	AAA	2
9D	012481315.IB	24 浦发集团 SCP002	AAA	1.98
12D	012481198.IB	24 福清核电 SCP002	AAA	2.03
12D	012481198.IB	24 福清核电 SCP002	AAA	2.03
28D	012481957.IB	24 大横琴 SCP003	AAA	2.1
29D	012483057.IB	24 中化股 SCP003	AAA	100

30D	012482181.IB	24 宁沪高 SCP010	AAA	2.01
30D	012481232.IB	24 上海医药 SCP002	AAA	2.08
32D(休 1)	012481391.IB	24 湘高速 SCP005	AAA	2.15
43D	012482375.IB	24 华能 SCP008	AAA	1.9748
43D	012482375.IB	24 华能 SCP008	AAA	1.9748
43D	012482375.IB	24 华能 SCP008	AAA	1.9748
43D	012482375.IB	24 华能 SCP008	AAA	1.9748
43D	012482375.IB	24 华能 SCP008	AAA	1.9748
43D	012482375.IB	24 华能 SCP008	AAA	1.9748
72D	012480704.IB	24 吴中经发 SCP003	AA+	2.06
72D	012480704.IB	24 吴中经发 SCP003	AA+	2.06
78D	012483008.IB	24 首旅 SCP007	AAA	2.03
79D	012480843.IB	24 滨建投 SCP001	AAA	2.12
79D	012481797.IB	24 苏州高新 SCP030	AAA	2.04
86D	012481589.IB	24 中交二航 SCP003(科创票 据)	AAA	2.03
87D(休 2)	012481852.IB	24 渝医药 SCP005	AA+	2.15
95D(休 1)	012481469.IB	24 中交二航 SCP002(科创票 据)	AAA	2.0553
95D(休 1)	012481469.IB	24 中交二航 SCP002(科创票 据)	AAA	2.0553
97D	012481145.IB	24 园博园 SCP001	AA	2.22
112D	042480013.IB	24 云投 CP001	AAA	2.22
112D	042480013.IB	24 云投 CP001	AAA	2.22
121D	012481413.IB	24 国新租赁 SCP001	AAA	2.05
121D	012481386.IB	24 深燃气 SCP004	AAA	2
125D	012481533.IB	24 广州发展 SCP001	AAA	2.02
143D(休 2)	012481565.IB	24 浙越资产 SCP001	AA	2.4
155D	012483018.IB	24 大唐租赁 SCP006	AAA	2.07
159D	012481702.IB	24 江西交投 SCP003	AAA	2
174D	012481832.IB	24 海发国资 SCP002	AAA	2.1
176D	012481854.IB	24 中拓 SCP008	AA+	2.2
183D	012482524.IB	24 首钢股份 SCP003	AAA	2.04
183D	012482524.IB	24 首钢股份 SCP003	AAA	2.04
184D	012482365.IB	24 苏州高新 SCP040	AAA	2.05
186D(休 1)	012481961.IB	24 越秀交通 SCP002	AAA	2.05
201D	012482105.IB	24 赣国资 SCP004	AAA	2.03
212D	042480220.IB	24 云建投 CP002	AAA	2.27
212D	042480220.IB	24 云建投 CP002	AAA	2.27
212D	012482265.IB	24 浙交投 SCP012	AAA	1.98
212D	012482265.IB	24 浙交投 SCP012	AAA	1.98
233D	042480263.IB	24 荣盛 CP001	AAA	100
242D(休 1)	012482492.IB	24 杭商贸 SCP004	AAA	2.07
251D	012482625.IB	24 吴中经发 SCP013	AA+	2.12
274D	042480309.IB	24 景国资 CP002	AA+	2.2

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
------	------	------------	----	-----

6D	102101930.IB	21 苏国信 MTN008	AAA	2.01%
12D	132100122.IB	21 浙能源 GN002(碳中和债)	AAA	1.98%
37D	102102121.IB	21 华电股 MTN005	AAA	1.97%
55D	102102287.IB	21 佛公用 MTN001	AAA	2.03%
72D+2Y(休 1)	102103138.IB	21 镜湖开发 MTN003	AAA	2.06%
82D	102103216.IB	21 通用 MTN001	AAA	2.01%
93D	101901731.IB	19 港兴港投 MTN005	AAA	2.12%
117D	102100042.IB	21 长沙高新 MTN001A	AA+	2.09%
123D(休 1)	102280141.IB	22 通用 MTN001	AAA	2.01%
152D	102380213.IB	23 晋能电力 MTN003	AAA	2.07%
152D	102280279.IB	22 南航股 MTN001	AAA	2.03%
156D	102280299.IB	22 国际港务 MTN001	AAA	2.03%
187D+2Y	102280604.IB	22 桂铁投 MTN002	AAA	2.10%
189D	102382610.IB	23 济南轨交 MTN001	AAA	2.06%
194D	102380759.IB	23 胶州城投 MTN001	AA+	2.20%
194D	102380759.IB	23 胶州城投 MTN001	AA+	2.20%
202D+2Y	102280737.IB	22 光大绿环 MTN001BC(绿色)	AAA	2.10%
204D+1Y	102380802.IB	23 黄石城发 MTN001	AA+	2.22%
204D+1Y	102380802.IB	23 黄石城发 MTN001	AA+	2.22%
208D	102000656.IB	20 赣国资 MTN002	AAA	2.03%
214D(休 1)	102280831.IB	22 华电股 MTN002A	AAA	2.05%
223D	102000912.IB	20 宿迁城投 MTN002	AA+	2.11%
223D	102000912.IB	20 宿迁城投 MTN002	AA+	2.11%
230D+NY	102281058.IB	22 西安高新 MTN001	AAA	2.34%
230D+NY	102281058.IB	22 西安高新 MTN001	AAA	2.34%
252D	102001086.IB	20 栾川铝业 MTN001	AAA	2.15%
276D+NY(休 2)	102381482.IB	23 南山开发 MTN001	AAA	2.27%
333D(休 1)	102382096.IB	23 银川通联 MTN004	AA+	2.34%
335D	102001567.IB	20 渝城投 MTN001	AAA	2.06%
335D	102001567.IB	20 渝城投 MTN001	AAA	2.06%
335D	102001567.IB	20 渝城投 MTN001	AAA	2.06%
342D+2Y	102281949.IB	22 荆州城发 MTN002	AA+	2.17%
1.12Y+NY	102282420.IB	22 蜀道投资 MTN011	AAA	2.17%
1.13Y+NY	102282446.IB	22 沪电力 MTN002	AAA	2.13%
1.14Y(休 1)	102383020.IB	23 晋能煤业 MTN009	AAA	2.15%
1.19Y	102282574.IB	22 冀交投 MTN003	AAA	2.06%
1.21Y	101571012.IB	15 锡新区 MTN001	AA+	2.16%
1.26Y(休 1)	102282753.IB	22 泰交通 MTN002	AA+	2.15%
1.28Y+NY(休 1)	102383457.IB	23 京能电力 MTN003	AAA	2.16%
1.3Y+NY(休 1)	102480013.IB	24 佛燃能源 MTN001	AA+	2.28%
1.36Y+2Y	102100159.IB	21 成都高新 MTN001A	AAA	2.09%
1.45Y	102380370.IB	23 成都环境 MTN001	AAA	2.13%
1.51Y+2Y	102380673.IB	23 北控水集 MTN001A	AAA	2.10%
1.56Y(休 1)	102380834.IB	23 中关村集 MTN002A	AAA	2.12%
1.57Y	102380892.IB	23 中电投 MTN010	AAA	2.04%
1.6Y(休 1)	102100803.IB	21 京城投 MTN001B	AAA	2.23%
1.6Y(休 1)	102100803.IB	21 京城投 MTN001B	AAA	2.23%

1.67Y	102481963.IB	24 新华发行 MTN001	AA+	2.40%
1.67Y	102481963.IB	24 新华发行 MTN001	AA+	2.40%
1.76Y+NY(休 1)	102381485.IB	23 华电 MTN005B(能源保供特别债)	AAA	2.12%
1.84Y+NY	102381769.IB	23 华润 MTN002	AAA	2.12%
1.93Y+NY	102300458.IB	23 大唐集 MTN011	AAA	2.12%
1.95Y(休 1)	102101737.IB	21 武侯资本 MTN002	AA+	2.20%
2.07Y+NY	102382689.IB	23 大唐集 MTN016	AAA	2.12%
2.09Y+NY	102382764.IB	23 大唐集 MTN017	AAA	2.11%
2.09Y+NY	102382764.IB	23 大唐集 MTN017	AAA	2.12%
2.15Y+NY	102383045.IB	23 晋能装备 MTN007	AAA	2.32%
2.18Y	102383124.IB	23 阜阳建投 MTN001	AA+	2.28%
2.3Y	102480009.IB	24 惠山国投 MTN001	AA+	2.235%
2.3Y	102480009.IB	24 惠山国投 MTN001	AA+	2.235%
2.36Y+NY	102480302.IB	24 鲁黄金 MTN001(科创票据)	AAA	2.21%
2.37Y(休 1)	102480378.IB	24 岳阳建投 MTN002	AA+	2.25%
2.45Y+NY(休 1)	102480574.IB	24 晋能装备 MTN002	AAA	2.32%
2.46Y+2Y(休 1)	102480658.IB	24 海淀国资 MTN001A	AAA	2.20%
2.46Y+2Y	102480716.IB	24 济宁城投 MTN003A	AA+	2.45%
2.56Y	102481360.IB	24 广新控股 MTN001	AAA	2.17%
2.56Y	132480035.IB	24 华能 GN001(碳中和债)	AAA	2.03%
2.56Y	132480035.IB	24 华能 GN001(碳中和债)	AAA	2.03%
2.56Y	132480035.IB	24 华能 GN001(碳中和债)	AAA	2.03%
2.57Y	102481383.IB	24 溧水产投 MTN002	AA	2.35%
2.57Y	102481383.IB	24 溧水产投 MTN002	AA	2.35%
2.6Y	132480038.IB	24 中国电力 GN001(可持续挂钩)	AAA	2.1129%
2.6Y	132480038.IB	24 中国电力 GN001(可持续挂钩)	AAA	2.1129%
2.75Y(休 1)	102482388.IB	24 建安投资 MTN001	AA+	2.33%
2.75Y(休 1)	102482388.IB	24 建安投资 MTN001	AA+	2.33%
2.77Y+2Y	102482722.IB	24 苏州高技 MTN002(并购)	AAA	2.24%
2.83Y+2Y	102483065.IB	24 松江国投 MTN001	AAA	2.16%
2.83Y+2Y	102483065.IB	24 松江国投 MTN001	AAA	2.16%
2.94Y+NY	102483592.IB	24 大唐集 MTN008	AAA	2.16%
2.94Y+NY	102483592.IB	24 大唐集 MTN008	AAA	2.16%
4.46Y(休 1)	102480646.IB	24 川发展 MTN001A	AAA	2.22%
4.53Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	2.12%
4.6Y	102481710.IB	24 温州城建 MTN002	AAA	2.25%
4.67Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.12%
4.69Y+5Y(休 2)	102482056.IB	24 洋河 MTN001	AAA	2.25%
4.76Y	102482411.IB	24 丰城发投 MTN002	AA+	2.76%
4.82Y(休 1)	102400855.IB	24 合肥产投 MTN002A	AAA	2.34%
4.82Y(休 1)	102400855.IB	24 合肥产投 MTN002A	AAA	2.34%
4.82Y(休 1)	102400855.IB	24 合肥产投 MTN002A	AAA	2.34%
4.82Y(休 1)	102400855.IB	24 合肥产投 MTN002A	AAA	2.34%
4.86Y	102483261.IB	24 汇金 MTN005	AAA	2.125%
4.89Y	102483383.IB	24 厦国贸控 MTN012	AAA	2.57%

4.92Y	102483622.IB	24 津保投 MTN003	AAA	3.10%
4.98Y	102484026.IB	24 苏交通 MTN012	AAA	2.17%
4.99Y	102484132.IB	24 中电投 MTN022	AAA	2.15%
9.23Y(休 1)	102383298.IB	23 中信集团 MTN005B	AAA	2.30%
9.35Y	102480288.IB	24 川能投 MTN001	AAA	2.49%
9.46Y	102480674.IB	24 诚通控股 MTN007A	AAA	2.40%
9.71Y(休 2)	102482116.IB	24 川投资 MTN002	AAA	2.51%
9.76Y	102482422.IB	24 中铁股 MTN002B	AAA	2.31%
9.79Y(休 1)	102400840.IB	24 亦庄投资 MTN003B	AAA	2.505%
9.82Y(休 2)	102483017.IB	24 中石油 MTN002	AAA	2.30%
9.88Y	102483392.IB	24 中铝集 MTN004	AAA	2.40%
9.9Y(休 2)	102483473.IB	24 国电 MTN002	AAA	2.30%
14.87Y	102483302.IB	24 华润 MTN005	AAA	2.35%
14.87Y	102483302.IB	24 华润 MTN005	AAA	2.35%
14.94Y	102483736.IB	24 深圳地铁 MTN006	AAA	2.461%

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
6D	2120084.IB	21 桂林银行三农债 03	AAA	1.95%
9D	2120086.IB	21 浙商银行小微债 01	AAA	1.87%
65D+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA	1.96%
79D	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	1.84%
79D	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	1.84%
79D	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	1.84%
99D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.02%
99D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.02%
129D(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	1.95%
156D	2228009.IB	22 光大银行小微债	AAA	1.91%
164D(休 2)	2228015.IB	22 浦发银行 03	AAA	1.96%
164D(休 2)	2228015.IB	22 浦发银行 03	AAA	1.96%
164D(休 2)	2228015.IB	22 浦发银行 03	AAA	1.96%
180D	2220019.IB	22 南京银行 01	AAA	1.95%
214D+5Y(休 2)	2020022.IB	20 南京银行二级 01	AAA	2.04%
245D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.00%
319D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.025%
319D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.025%
319D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.025%
319D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.025%
319D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.025%
326D+5Y(休 2)	2020044.IB	20 宁波银行二级	AAA	2.05%
361D+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.01%
361D+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.01%
361D+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.01%
1.01Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.01%
1.18Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.045%
1.18Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.04%
1.33Y(休 1)	292380001.IB	23 德银股份债 01	AAA	2.1075%
1.72Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.05%

1.85Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	1.96%
1.85Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	1.96%
1.89Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.03%
2.24Y+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	2.08%
2.52Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02	AAA	1.955%
2.57Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	2.05%
2.6Y	2420015.IB	24 海南银行小微债	AA+	2.15%
2.81Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.97%
2.81Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.97%
2.89Y(休 1)	212480018.IB	24 湖南银行债 01	AAA	2.04%
2.89Y(休 1)	212480018.IB	24 湖南银行债 01	AAA	2.04%
2.9Y	212480019.IB	24 恒丰银行债 01	AAA	2.05%
2.9Y	212480019.IB	24 恒丰银行债 01	AAA	2.04%
2.93Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	2.09%
2.94Y	2420037.IB	24 湖州银行绿色债	AA+	2.15%
2.95Y(休 1)	2420036.IB	24 温州银行 01	AAA	2.16%
2.98Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA	100
2.98Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA	100
2.98Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA	100
4.08Y+NY	242380019.IB	23 邮储永续债 01	AAA	2.15%
4.08Y+NY	242380019.IB	23 邮储永续债 01	AAA	2.15%
4.16Y+NY	242380026.IB	23 杭州联合农商永续债 01	AAA/AA+	2.35%
4.5Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.17%
4.5Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.17%
4.6Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.20%
4.6Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.20%
4.66Y+1Y	312400002.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.12%
4.71Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.1775%
4.71Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.1775%
4.71Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.1775%
4.71Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.18%
4.75Y+5Y(休 2)	232400022.IB	24 成都银行二级资本债 01	AAA	2.32%
4.75Y+5Y(休 2)	232400022.IB	24 成都银行二级资本债 01	AAA	2.32%
4.75Y+5Y(休 2)	232400022.IB	24 成都银行二级资本债 01	AAA	2.32%
4.8Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.14%
4.8Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.14%
4.81Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.18%
4.85Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.1375%
4.85Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.1375%
4.85Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.14%
4.85Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.14%
4.85Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.14%
4.85Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.1375%
4.86Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.18%
4.86Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.18%
4.88Y+5Y(休 2)	232400032.IB	24 成都银行二级资本债 02	AAA	2.32%
4.94Y+NY(休 1)	242400019.IB	24 江苏银行永续债 02	AAA	2.245%

4.94Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.185%
4.94Y+NY	242400021.IB	24 台州银行永续债 02	AAA/AA+	2.42%
4.94Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.185%
4.95Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.1375%
4.95Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.1375%
4.95Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.145%
4.95Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.13%
4.95Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.13%
9.95Y+1Y	312410007.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01C(BC)	AAA	2.26%
37D	188926.SH	21 华泰 15	AAA	1.95%
40D+4Y	184067.SH	21 双桥 01	AA/AAA	2.60%
41D+NY	155869.SH	19 铁建 Y2	AAA	2.06%
47D+1Y	177036.SH	S20 凉山 2	AA+	2.60%
58D	185012.SH	21 中船 01	AAA	2.01%
63D	162426.SH	19 济西 03	AAA	2.09%
63D	162426.SH	19 济西 03	AAA	2.09%
67D(休 1)	032191326.IB	21 萧县交投 PPN001(乡村振 兴)	AA/AAA	2.50%
76D	185083.SH	21 国新 04	AAA	2.02%
81D(休 1)	185097.SH	21 中金 G7	AAA	1.95%
121D+1Y(休 2)	138841.SH	23 中金 G1	AAA	1.95%
124D	032380094.IB	23 东方医药 PPN001	AA	2.35%
130D(休 1)	149795.SZ	22 龙城 01	AAA	2.09%
158D(休 1)	185402.SH	22 沪电 01	AAA	2.03%
177D+2Y(休 1)	194034.SH	22 启东 01	AA+	2.15%
177D+2Y(休 1)	194034.SH	22 启东 01	AA+	2.15%
180D+2Y	194171.SH	22 江开 03	AAA	2.12%
187D+5Y(休 1)	2023002.IB	20 中邮人寿	AAA	2.10%
213D(休 2)	185683.SH	22 东兴 G1	AAA	2.01%
214D(休 1)	185651.SH	22 沪电 03	AAA	2.04%
223D+10Y(休 1)	166733.SH	20 扬经开	AA/AAA	2.20%
261D	185835.SH	22 产融 02	AAA	2.07%
282D+2Y(休 1)	185803.SH	22 城建 01	AAA	2.15%
295D	032000625.IB	20 泰安城乡 PPN001	AA	2.42%
298D(休 1)	185964.SH	22 玄武 01	AA+	2.12%
303D	115636.SH	23 市北 01	AA+	2.13%
342D+2Y	137727.SH	22 穗发 02	AAA	2.07%
342D+2Y	137727.SH	22 穗发 02	AAA	2.07%
354D+2Y	182636.SH	22 眉产债	AA/AAA	2.41%
361D(休 1)	2180375.IB	21 南阳投资小微债 01	AA+	2.17%
1Y+2Y(休 2)	175166.SH	20 赣铁 01	AAA	2.08%
1.01Y(休 2)	137843.SH	22 首钢 01	AAA	2.09%
1.01Y	252541.SH	23 株高 05	AA+	2.33%
1.02Y	1880158.IB	18 湖州城投债 01	AAA	2.08%
1.16Y	240241.SH	23 财券 G5	AAA	2.04%
1.19Y	152015.SH	PR 永安 01	AA	3.00%

1.26Y+NY	138773.SH	华电 YK02	AAA	2.11%
1.33Y	138853.SH	23 华福 G1	AAA	2.04%
1.56Y+1Y	133232.SZ	22 周口 02	AA+	2.355%
1.58Y(休 2)	240897.SH	24 方正 G3	AAA	2.15%
1.61Y+NY	250847.SH	23 晋旅 Y1	AA+	2.60%
1.73Y+2Y	115478.SH	23 穗建 05	AAA	2.19%
1.74Y	148326.SZ	23 长江 03	AAA	2.07%
1.83Y(休 1)	152957.SH	21 亦庄 03	AAA	2.12%
1.84Y	152973.SH	21 水集 01	AAA	2.50%
1.84Y	152973.SH	21 水集 01	AAA	2.50%
1.94Y	152261.SH	19 滨海债	AA/AAA	2.20%
1.94Y	115877.SH	23 海国 04	AAA	2.18%
1.99Y	188756.SH	21 临债 04	AAA	2.13%
2.13Y	240169.SH	G23 国发 1	AAA	2.10%
2.14Y(休 1)	188967.SH	21 建材 08	AAA	2.09%
2.14Y(休 1)	188967.SH	21 建材 08	AAA	2.08%
2.25Y	253315.SH	23 焦投 06	AA+	2.34%
2.25Y	253315.SH	23 焦投 06	AA+	2.34%
2.32Y	240485.SH	24 辽港 01	AAA	2.20%
2.47Y	240649.SH	24 财通 C1	AAA/AA+	2.15%
2.72Y	148766.SZ	24 赣金 01	AA+	2.40%
2.72Y	254914.SH	24 新证 F2	AAA	2.23%
2.77Y+NY(休 1)	148794.SZ	24 河钢 Y1	AAA	2.44%
2.77Y+NY(休 1)	148794.SZ	24 河钢 Y1	AAA	2.44%
2.77Y+NY(休 1)	148794.SZ	24 河钢 Y1	AAA	2.44%
2.89Y	241420.SH	24 融和 04	AAA	2.20%
2.92Y	241488.SH	24 国管 01	AAA	2.09%
2.92Y	241488.SH	24 国管 01	AAA	2.09%
2.99Y	2422052.IB	24 中银消费金融债 05	AAA	2.18%
3.99Y+5Y	272380013.IB	23 建信人寿资本补充债 01	AAA	2.26%
4.47Y+NY	240657.SH	24 中证 Y2	AAA	2.24%
4.59Y	240889.SH	24 八局 K1	AAA	2.28%
4.66Y+NY	241010.SH	24 豫通 Y8	AAA	2.30%
4.7Y	241021.SH	24 川资 02	AAA	2.365%
4.7Y	241021.SH	24 川资 02	AAA	2.365%
4.7Y	241021.SH	24 川资 02	AAA	2.365%
4.75Y	148781.SZ	24 长城 04	AAA	2.20%
4.75Y+NY	241157.SH	华能 YK09	AAA	2.24%
4.75Y+NY	241157.SH	华能 YK09	AAA	2.24%
4.81Y	255249.SH	24 商丘 02	AA+	2.75%
4.98Y	241597.SH	24 豫港 04	AAA	3.00%
4.98Y+NY	241621.SH(09.19 上市)	延长 KY12	AAA	2.30%
5.53Y	2380080.IB	23 荆门城投债	AA/AAA	2.41%
8.99Y	115993.SH	23 国管 02	AAA	2.32%
9.52Y	240796.SH	24 鲁信 01	AAA	2.53%
9.52Y	240796.SH	24 鲁信 01	AAA	2.53%
9.89Y	241373.SH	24 洪轨 02	AAA	2.51%

9.89Y	241373.SH	24 洪轨 02	AAA	2.51%
9.93Y	241472.SH	24 中化 12	AAA	2.44%
18.11Y	2280453.IB	22 铁道 15	AAA	2.245%

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