

收盘日评 银行间债券市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2026-02-02】

国债

今日央行开展 750 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 1505 亿，逆回购口径资金净回笼 755 亿。

国债方面 2.06Y 250005 1.34-1.34； 3.98Y 250003 1.505-1.515； 6.14Y 250007 1.6325-1.65； 9.56Y 250016 1.80-1.8175； 29.56Y 2500006 2.245-2.255。

	1y	3y	5y	7y	10y	30y
昨日国债(%)	1.2100	1.3700	1.5715	1.6770	1.8090	2.2600
今日国债(%)	1.2100	1.3725	1.5725	1.6875	1.8135	2.2510
变动(%)	0.0000	0.0025	0.0010	0.0105	0.0045	-0.0090

金融债

金融债方面 3D 250401 1.43-1.43； 3.05Y 240203 1.67-1.675； 5.96Y 220205 1.825-1.825； 9.37Y 250215 1.95-1.96。

	1y	3y	5y	7y	10y
昨日非国开金融债(%)	1.5390	1.6425	1.7250	1.8950	1.9845
今日非国开金融债(%)	1.5500	1.6425	1.7200	1.8950	1.9825
变动(%)	0.0110	0.0000	-0.0050	0.0000	-0.0020
昨日国开债(%)	1.5200	1.6950	1.7320	1.8825	1.9590
今日国开债(%)	1.5200	1.6900	1.7300	1.8800	1.9570
变动(%)	0.0000	-0.0050	-0.0020	-0.0025	-0.0020

银行债

5y 大行二级收益率今日开盘后区间内持续大幅震荡。非免税券前收 2.107 (+0.57)，今开 2.095 (-0.67)。日内最高 2.115 (+1.27)，最低 2.09 (-1.23)，震荡区间 1.5bp，今收 2.115(+1.27)，尾盘对峙为 2.1175/2.115。盘中与同期限大行永续相差约 5bp，券商基金为主要参与方；

五年 25 工行二级资本债 02BC 前收 2.035 (-0.2)，今开 2.0225(-1.45)，日内最高 2.045(+0.8)，最低 2.0225(-1.45)，今收 2.045(+0.8)，尾盘对峙为 2.1175/2.115，市场成交依旧火热；

十年 25 农行二级资本债 03B(BC)昨,2.465 (+0.29) 今开 2.465(+0.29),最高 2.47(+0.79), 最低 2.465(+0.29),今收 2.47(+0.79),尾盘对峙为 2.475/2.4725；

5y 股份制二永收益震荡上行。4.83y 平安永续成交在 2.295 (-0.57) 到 2.30 (-0.07)，震荡区间 0.5 bp。今日股份制二永成交情绪清淡，基金有参与。

1-3y 大行二级今日成交收益率持续走高，尾盘趋于平稳：1y 大行今开 1.685/1.675，成交在 1.685 (+0.18)，尾盘收在 1.695/1.69。2y 大行今开 1.75/1.74，成交在 1.76 (+1.21)，尾盘收在 1.765/1.7625。今日 1-3y 大行二级交易情绪较清淡，盘内卖盘力量较强于买盘，今日基金理财为主要参与机构。

5y 股份制二永收益震荡上行。4.83y 平安永续成交在 2.295 (-0.57) 到 2.30 (-0.07)，震荡区间 0.5 bp。今日股份制二永成交情绪清淡，基金有参与。

商金方面，1-3y 大行主要成在 (-2) 到 (+1)。1.31y 24 交行债 01 成在 1.66 (-1.7) 到 1.665 (-1.2)。股份制主要成在 (-1.5) 到 (+0.5)。1.44y 24 中信银行债 01 成在 1.69 (-0.04)。大城商行今日主要成在 (-1.5) 到 (+1)。2.8y 25 南京银行债 02BC 成在 1.80 (-0.70)。科创今日成在 (+0.5) 到 (+2)。收益率保持低位。基金、银行/银行、基金为主。

短期融资券

今日银行间短融市场交投活跃度一般，成交主要集中于 2026Q1Q2 期限。短端方面，4D 072510103.IB 25 方正证券 CP002 AAA 成交在 1.65% (估值+2 位置)，基金出给基金；73D 012680139.IB 26 楚天智能 SCP001 AAA 成交在 1.67% (+0.5)，银行出给基金。中长端方面，143D 012680252.IB 26 南航股 SCP001 AAA 成交在 1.6525% (-1.55)，银行出给基金；171D 012680317.IB 26 厦国贸 SCP005 AAA 成交在 1.74% (-0.83)，银行出给基金。长端方面，250D(休 2) 012680105.IB 26 象屿 SCP001 AAA 成交在 1.94% (-0.39)，银行出给证券。197D 012582841.IB 25 南航股 SCP013 AAA 成交在 1.65% (-2.22)，银行出给基金。总体而言，短端、中长端和长端收益日内震荡。

中期票据

今日中票收益早盘在估值-1左右，尾盘成在估值+1左右。汇金、电网成交活跃度今日较低，5y 汇金今日在 1.94% (-0.89) 成交。10Y 电网成在 2.30% (-0.37)。

1-3Y，好名字整体成交在估值-2 到估值+3，2.75Y 23 锦江国际 MTN001 成在 1.85% (-0.29)，2.43Y 23 鲁信 MTN003 成在 1.94% (+0.20)，1.44Y 24 南航股 MTN008 成在 1.74% (+0.32)。成交收益率集中在 1.80%-2.00%，保险/银行为主。

3-5Y，好名字整体成交在估值-2 到估值+1，3.65Y 24 国盛 MTN003 成在 1.92% (-0.25)，4.95Y 26 上实 MTN001 成在 2.00% (-0.65)，4.94Y 26 蜀道投资 MTN001 成在 2.045% (+0.42)，收益率集中在 1.90%-2.10%，银行/基金、资管为主。

5Y+，5.46Y 21 国新控股 MTN001 成在 2.02% (+0.27)；18.21Y 24 国新控股 MTN001B 成在 2.44% (-0.1)，成交收益率主要集中在 2.40%-2.60% 永续中票集中在 5Y 左右的普通名字，成交收益率大概在估值-3/+1，资管/基金为主。

企业债

交易所信用债全天交投较为活跃，基金，券商，保险，理财均有参与。全天收益震荡。

1年内，券商债成交在估值到估值+2 (353D 26 申证 D2 1.6875)，理财基金买，基金银行卖；非券商债多成交在 1.68-1.78，(266D 21 国新 03 1.69)，基金理财买，基金保险券商卖；年内科创债今日成交寥寥 (324D 25 大唐 SK 1.70)。

1-3年，今日券商债成交尚可，在估值到估值+2 (2.98Y 26 中证 G3 1.83)，基金券商理财买，基金券商卖；非券商债多成交在 1.74-1.88，(2.99Y 24 重发 01 1.88)，基金券商买，基金理财保险卖。科创债成交尚可，在估值附近 (2.98Y+2Y 26 浦创 K1 1.85)。

3-5年，券商债今日成交寥寥；非券商债方面今日成交尚可，成交在估值-0.5 到估值+1.5 (4.32Y+NY 25 铁投 Y2 2.455)，基金券商资管双边参与，券商买，银行保险卖；科创方面今日成交尚可，成交多在估值-1 到估值+1 (4.72Y 25 国电 K3 1.89)，基金双边参与，券商资管买，银行保险卖。

5Y+，券商债成交寥寥；非券商债成交较少，(8.22Y 24 中化 04 2.56)，成交多在估值-0.5 到估值+1 之间，基金券商自营双边参与买卖盘；科创方面亦成交较少，(9.75Y 25 国新 K1 2.33)，成交多在估值+0.5 附近，基金双边参与买卖盘。

美元债

周一市场整体平稳。城投板块，获利了结卖盘有所增加，美元城投未见明显变动，而 5% 以上点心债持续有买盘需求。地产板块，万科小幅回落 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 (%)
4D	072510103.IB	25 方正证券 CP002	AAA	1.65
11D	012582088.IB	25 鄂交投 SCP003	AAA	1.61
56D	012581560.IB	25 温州现代 SCP001	AA+	1.7
71D	012583060.IB	25 鄂能源 SCP004	AAA	1.67
73D	012680139.IB	26 楚天智能 SCP001	AAA	1.67
73D	012680139.IB	26 楚天智能 SCP001	AAA	1.67
80D	012680226.IB	26 江苏铁路 SCP001	AAA	1.665
80D	012680226.IB	26 江苏铁路 SCP001	AAA	1.665
115D	012680277.IB	26 陕西金控 SCP001	AAA	1.72
115D	012680277.IB	26 陕西金控 SCP001	AAA	1.72
130D	012680279.IB	26 苏州高新 SCP004	A	1.69
143D	012680252.IB	26 南航股 SCP001	AAA	1.6525
166D(休 2)	012583013.IB	25 邮政 SCP005	AAA	1.68
171D	012680317.IB	26 厦国贸 SCP005	AAA	1.74
186D	012583046.IB	25 象屿 SCP003	AAA	1.92
197D	012582841.IB	25 南航股 SCP013	AAA	1.65
206D	012680299.IB	26 电网 SCP005	AAA	1.6575
206D	012680299.IB	26 电网 SCP005	AAA	1.6575
214D	012680047.IB	26 厦翔业 SCP001	AAA	1.68
214D	012680047.IB	26 厦翔业 SCP001	AAA	1.68
225D	042580512.IB	25 南电 CP007	AAA	1.6525
225D	042580513.IB	25 南电 CP006	AAA	1.6525
250D(休 2)	012680105.IB	26 象屿 SCP001	AAA	1.94

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 (%)
26D+NY(休 2)	102480570.IB	24 象屿股份 MTN001	AAA	1.91
42D+NY(休 2)	102480867.IB	24 鄂联投 MTN001	AAA	1.81
42D+NY(休 2)	102480867.IB	24 鄂联投 MTN001	AAA	1.81
42D+NY(休 2)	102480867.IB	24 鄂联投 MTN001	AAA	1.81
60D+1Y	102481320.IB	24 水发集团 MTN004	AAA	1.85

84D+NY(休 2)	102381043.IB	23 江西交投 MTN002	AAA	1.73
84D	102381111.IB	23 武汉生态 MTN001	AA+	1.72
99D	102100962.IB	21 川铁投 MTN005	AAA	1.7
118D(休 1)	102381277.IB	23 惠山高科 MTN003	AA+	1.74
137D(休 3)	102381450.IB	23 苏州高新 MTN004	A	1.75
155D	101664036.IB	16 同盛投资 MTN001	AAA	1.685
155D	102381606.IB	23 徐州交通 MTN002	AAA	1.72
160D(休 1)	102381637.IB	23 海曙广聚 MTN003	AA+	1.73
164D	102101310.IB	21 南京国投 MTN001	AAA	1.715
167D(休 1)	102381717.IB	23 宜兴城投 MTN001	AA+	1.73
169D	102101331.IB	21 冀港集 MTN001	AAA	1.71
237D(休 1)	102101966.IB	21 平湖城投 MTN003	AA+	1.74
267D	102382892.IB	23 临沂城投 MTN002	AAA	1.75
267D	102382917.IB	23 冀交投 MTN006	AAA	1.71
273D+1.99Y	102382952.IB	23 淄博高新 MTN001	BBB	1.95
1.21Y+NY(休 1)	102481570.IB	24 江西交投 MTN006	AAA	1.8
1.22Y	102280890.IB	22 蜀道投资 MTN006	AAA	1.76
1.38Y(休 1)	102482388.IB	24 建安投资 MTN001	AA+	1.85
1.4Y(休 1)	102482775.IB	24 南航股 MTN008	AAA	1.74
1.48Y	102281664.IB	22 电网 MTN004	AAA	1.72
1.49Y(休 2)	102483278.IB	24 中建材 MTN001	AAA	1.75
1.49Y(休 2)	102483278.IB	24 中建材 MTN001	AAA	1.75
1.52Y	102483468.IB	24 华电股 MTN004A	AAA	1.73
1.53Y	102483504.IB	24 辽港集团 MTN003	AAA	1.87
1.53Y	102483504.IB	24 辽港集团 MTN003	AAA	1.87
1.54Y	102483580.IB	24 海格通信 MTN001(科创票据)	AAA	1.86
1.54Y	102483580.IB	24 海格通信 MTN001(科创票据)	AAA	1.86
1.56Y+2Y	102400926.IB	24 长寿开投 MTN003A	AA+	1.95
1.7Y+2Y(休 2)	102400986.IB	24 诸暨国资 MTN001	AAA	1.84
1.7Y+2Y(休 2)	102400986.IB	24 诸暨国资 MTN001	AAA	1.84
1.7Y+2Y(休 2)	102400986.IB	24 诸暨国资 MTN001	AAA	1.84
1.75Y	102484750.IB	24 晋能煤业 MTN013	AAA	1.87
1.75Y	102484750.IB	24 晋能煤业 MTN013	AAA	1.87
1.76Y(休 1)	102584670.IB	25 现代投资 MTN002(科创债)	AA+	1.83
1.84Y+2Y(休 1)	102585109.IB	25 粤财投资 MTN003	AAA	1.81
1.87Y+NY	102585213.IB	25 福建港口 MTN001	AAA	1.97
1.93Y	102580040.IB	25 五矿集 MTN003	AAA	1.79
1.93Y(休 2)	102580056.IB	25 晋能煤业 MTN001	AAA	1.9
1.94Y	102380028.IB	23 广州高新 MTN001	AAA	1.85
1.97Y(休 2)	102580444.IB	25 颐养健康 MTN001	AAA	2.05
2.08Y(休 2)	102580901.IB	25 东风汽车 MTN001(两新)	AAA	1.84
2.21Y	102581710.IB	25 国航 MTN003	AAA	1.84
2.21Y	102581705.IB	25 光明 MTN001	AAA	1.82
2.4Y	102381546.IB	23 汇金 MTN004	AAA	1.81
2.43Y	102381630.IB	23 鲁信 MTN003	AAA	1.94
2.53Y+2Y(休 1)	102583439.IB	25 萧山国资 MTN002	AAA	1.86
2.53Y+2Y(休 1)	102583439.IB	25 萧山国资 MTN002	AAA	1.86
2.53Y+2Y(休 1)	102583439.IB	25 萧山国资 MTN002	AAA	1.86
2.56Y	102583603.IB	25 十堰国投 MTN001	AA	2.1
2.9Y+2Y	102585364.IB	25 宿迁水务 MTN001	AA+	1.95
2.92Y	102400581.IB	24 渝富 MTN001	AAA	1.89
2.92Y	102400581.IB	24 渝富 MTN001	AAA	1.89
2.93Y	102680057.IB	26 悦达 MTN001	AAA	2.5

2.97Y	102680289.IB	26 海淀国资 MTN001A	AAA	2.02
3.36Y	102482236.IB	24 苏交通 MTN008	AAA	1.88
3.4Y+NY	102482782.IB	24 义乌国资 MTN002	AAA	2.26
3.55Y	102483634.IB	24 杭金投 MTN002	AAA	2.02
3.61Y	102484130.IB	24 中油股 MTN002	AAA	1.89
3.62Y+NY	102484078.IB	24 中交一公 MTN002A	AAA	2.2
4.23Y(休 1)	102581923.IB	25 上实 MTN002(科创票据)	AAA	100
4.56Y	102583670.IB	25 两江产业 MTN002	AAA	2.09
4.6Y	102583806.IB	25 水发集团 MTN013	AAA	3.105
4.64Y	102584075.IB	25 上实 MTN004A	AAA	2
4.81Y(休 1)	102501712.IB	25 中建 MTN001(科创债)	AAA	2.01
4.81Y+5Y	102584943.IB	25 新都香城 MTN001	AA	2.57
4.81Y	101551097.IB	15 华能集 MTN003	AAA	1.955
4.82Y	102585010.IB	25 陕西交通 MTN011	AAA	2.035
4.82Y	102585010.IB	25 陕西交通 MTN011	AAA	2.04
4.84Y	102585116.IB	25 上实 MTN005	AAA	2
5.39Y	102585368.IB	25 电网 MTN045(科创债)	AAA	2
5.39Y	102585368.IB	25 电网 MTN045(科创债)	AAA	2
5.46Y(休 1)	102101324.IB	21 国新控股 MTN001	AAA	2.02
8.49Y	102483276.IB	24 中石化 MTN001	AAA	2.26

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（%）
32D	138996.SH	23 平证 04(免)	AAA	1.61
32D	115004.SH	23 海通 04(免)	AAA	1.61
33D(休 2)	240670.SH	24 光证 G1(免)	AAA	1.7
39D	243633.SH	25 兴业 S1	AAA/A-1	1.64
42D	136284.SH	16 浙交 02	AAA	1.65
53D+2Y	115131.SH	23 浦房 01	AAA	1.73
76D(休 1)	115242.SH	23 浙资 01	AAA	1.68
101D	244449.SH	25 东吴 S2	AAA/A-1	1.67
106D	148292.SZ	23 华股 02(免)	AAA	1.62
114D	149487.SZ	21 惠交 02	A/AAA	1.72
117D(休 2)	258782.SH	25 长寿 D1	AA+	1.93
133D+2Y	115452.SH	23 义乌 G1	AAA	1.7
151D	251591.SH	23 扬教 01	AA	1.8
224D	252389.SH	23 陕旅 04	AAA	1.98
231D+NY	240001.SH	23 漳九 Y1	AAA	1.85
266D	188929.SH	21 国新 03	AAA	1.69
287D+NY(休 1)	149700.SZ	21 申证 Y3(免)	AAA	1.735
1.07Y(休 2)	242497.SH	25 华泰 G3(免)	AAA	1.66
1.07Y(休 1)	253985.SH	24 齐财 01	AA/AA+	2.17
1.09Y(休 2)	240625.SH	24 东吴 01(免)	AAA	1.67
1.09Y+NY(休 1)	240648.SH	24 港务 Y1	AAA	1.78
1.09Y+NY(休 1)	240648.SH	24 港务 Y1	AAA	1.78
1.22Y	240935.SH	24 国投 01	AAA	1.71
1.22Y(休 2)	148712.SZ	24 天山 K1	AAA	1.75
1.38Y+NY(休 2)	255094.SH	24 晋旅 Y1	AA+	2.24
1.48Y	148829.SZ	24 深担 01	AAA	1.74
1.68Y+NY(休 1)	137871.SH	22 中金 Y2(免)	AAA	1.82
1.7Y+NY	243875.SH	晋建 YK01	AAA	2.31
1.7Y+NY	243875.SH	晋建 YK01	AAA	2.31
1.8Y	241985.SH	24 洪政债	AAA	1.8
1.81Y	148132.SZ	22 润置 13	AAA	2.14
1.82Y(休 2)	271203.SH	24 雄集 02	AAA	1.81

1.82Y(休 2)	271203.SH	24 雄集 02	AAA	1.81
1.82Y(休 2)	271203.SH	24 雄集 02	AAA	1.81
1.82Y(休 2)	271203.SH	24 雄集 02	AAA	1.81
1.88Y	244456.SH	25 方正 G8	AAA	1.86
1.88Y	244456.SH	25 方正 G8	AAA	1.86
2.11Y	524167.SZ	25 格力 03	AAA	2.04
2.13Y(休 1)	133968.SZ	25 坪投 01	AA+	2.05
2.3Y	115381.SH	23 洪轨 02	AAA	1.84
2.31Y+5Y	272380007.IB	23 人民人寿资本补充债 01(免)	AAA	1.86
2.42Y	243243.SH	25 中科 K1	AAA/AAAsti	2.07
2.57Y+2Y	252159.SH	23 中金 F2(免)	AAA	1.95
2.6Y+NY(休 1)	243724.SH	25HPI3YK	AAA/AAAsti	1.87
2.63Y+2Y	243845.SH	25 株发 03	AA+	2.04
2.63Y+2Y	243845.SH	25 株发 03	AA+	2.04
2.63Y+2Y	243845.SH	25 株发 03	AA+	2.03
2.71Y+NY	243990.SH	电投 KY14	AAA	1.9
2.79Y+2Y(休 2)	244101.SH	GK 隆基 01	AAA	2.86
2.97Y	281258.SH	26 建安 01	AA+	2.2
2.97Y	244556.SH	26 新证 C1	AAA	2.1
2.99Y	148595.SZ	24 重发 01	AAA	1.88
3.3Y	241031.SH	24 铁工 K1	AAA	1.82
4.32Y+NY	243021.SH	25 铁投 Y2	AAA	2.455
4.6Y+2Y(休 1)	134477.SZ	25 长轨 08	AAA	2.19
4.72Y	244011.SH	25 国电 K3	AAA	1.89
4.73Y(休 1)	243429.SH	25 厦贸 10	AAA	2.49
4.78Y	244183.SH	25 国电 K5	AAA	1.89
4.79Y+NY(休 1)	244192.SH	5SCNYKY6	AAA/AAAsti	2.21
4.81Y(休 1)	244291.SH	25 船舶 K3	AAA	1.89
4.93Y	281131.SH	26 鄂科 01	AAA	2.4
4.96Y(休 1)	244552.SH	26 蜀道 K1	AAA	1.97
4.96Y(休 1)	244551.SH	26 石资 K2	AAA/AAAsti	1.995
4.97Y	244537.SH	26 蓉轨 01	AAA	1.96
4.98Y(休 1)	244613.SH	26 中证 G4	AAA	1.96
8.07Y(休 1)	240618.SH	24CHNG1K	AAA	2.25
8.22Y(休 2)	240924.SH	24 中化 04	AAA	2.56
9.8Y	244181.SH	25CHNG1K	AAA/AAAsti	2.3
9.84Y	244365.SH	京资 K14	AAA/AAAsti	2.33
9.84Y	244365.SH	京资 K14	AAA/AAAsti	2.325
9.84Y	244365.SH	京资 K14	AAA/AAAsti	2.325
9.84Y	244352.SH	25CHNG2K	AAA/AAAsti	2.3
256D	032580656.IB	25 景德城投 PPN002	AA	1.99
1.15Y(休 2)	032400671.IB	24 济阳国投 PPN001	AA	2.16
4.99Y	032680068.IB	26 徐州交通 PPN001	AAA	2.34

今日银行债成交

剩余天数	债券代码	债券代码（发行机构）	评级	收益率（%）
50D	2320009.IB	23 昆仑银行绿色债 01(免)	AAA	1.6
56D	212380003.IB	23 华夏银行债 01(免)	AAA	1.58
56D	212380003.IB	23 华夏银行债 01(免)	AAA	1.58
56D	212380003.IB	23 华夏银行债 01(免)	AAA	1.58
78D+NY	2128016.IB	21 民生银行永续债 01(免)	AAA	1.69
83D(休 1)	2328011.IB	23 浙商银行小微债 01(免)	AAA	1.63
84D+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债(免)	AAA	1.67
84D+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债(免)	AAA	1.67

84D+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债(免)	AAA	1.67
115D+5Y	2120046.IB	21 广州银行二级(免)	AAA/AA+	1.7
115D+5Y	2120046.IB	21 广州银行二级(免)	AAA/AA+	1.7
126D+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01(免)	AAA	1.655
126D+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01(免)	AAA	1.655
128D+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债(免)	AAA	1.66
161D+5Y	2120062.IB	21 宁波银行二级 02(免)	AAA	1.695
175D+5Y	2120066.IB	21 邢台银行二级 01(免)	AA+/AA	2.31
189D+5Y	2128025.IB	21 建设银行二级 01(免)	AAA	1.675
203D+5Y	2128028.IB	21 邮储银行二级 01(免)	AAA	1.675
203D+5Y	2128028.IB	21 邮储银行二级 01(免)	AAA	1.675
203D+5Y	2128028.IB	21 邮储银行二级 01(免)	AAA	1.675
238D+5Y	2128030.IB	21 交通银行二级(免)	AAA	1.68
238D+5Y	2128030.IB	21 交通银行二级(免)	AAA	1.68
238D+5Y	2128030.IB	21 交通银行二级(免)	AAA	1.68
266D+5Y	2120092.IB	21 徽商银行二级 01(免)	AAA	1.725
287D+5Y	2128039.IB	21 中国银行二级 03(免)	AAA	1.68
297D+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债(免)	AAA	1.72
316D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02(免)	AAA	1.685
316D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02(免)	AAA	1.685
316D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02(免)	AAA	1.685
316D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02(免)	AAA	1.6825
320D(休 2)	2328026.IB	23 华夏银行 06(免)	AAA	1.65
329D+5Y	2121062.IB	21 北京农商二级(免)	AAA	1.72
1.05Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01(免)	AA+/AAA	1.7
1.05Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01(免)	AA+/AAA	1.7
1.06Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01(免)	AAA	1.69
1.15Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02(免)	AAA	1.67
1.15Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02(免)	AAA	1.67
1.15Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02(免)	AAA	1.67
1.24Y	212480010.IB	24 长沙银行债 01(免)	AAA	1.71
1.28Y	212480011.IB	24 浙商银行小微债 03(免)	AAA	1.7025
1.3Y	2420019.IB	24 徽商银行 01(免)	AAA	1.71
1.3Y	2420019.IB	24 徽商银行 01(免)	AAA	1.71
1.37Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01(免)	AAA	1.6975
1.37Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01(免)	AAA	1.6975
1.38Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01(免)	AA+/AAA	1.705
1.38Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01(免)	AA+/AAA	1.705
1.56Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01(免)	AAA	1.73
1.57Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A(免)	AAA	1.74
1.6Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01(免)	AAA	1.72
1.61Y(休 2)	292480020.IB	24 建行亚洲债 01BC(免)	AAA	1.78
1.61Y(休 2)	292480020.IB	24 建行亚洲债 01BC(免)	AAA	1.78
1.64Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A(免)	AA+/AAApi	1.7375
1.65Y	212480058.IB	24 交行债 02BC(免)	AAA	1.69
1.65Y	2428004.IB	24 中国银行三农债 01(免)	AAA	1.69
1.72Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01(免)	AAA	1.83
1.73Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A(免)	AAA	1.755
1.73Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A(免)	AAA	1.745
1.73Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A(免)	AAA	1.745
1.73Y	212400011.IB	24 南京银行债 03BC(免)	AAA	1.725
1.76Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A(免)	AAA	1.75
1.78Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A(免)	AAA	1.75

1.78Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A(免)	AAA	1.75
1.78Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A(免)	AAA	1.75
1.78Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A(免)	AAA	1.75
2.04Y	212580001.IB	25 浙商银行债 01A(免)	AAA	1.74
2.14Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A(免)	AA+/AAA	1.81
2.14Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A(免)	AA+/AAA	1.81
2.14Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A(免)	AA+/AAA	1.81
2.14Y(休 1)	2520004.IB	25 北京银行 01(免)	AAA	1.7475
2.14Y(休 1)	2520004.IB	25 北京银行 01(免)	AAA	1.7475
2.14Y(休 1)	2520004.IB	25 北京银行 01(免)	AAA	1.7475
2.14Y(休 1)	2520004.IB	25 北京银行 01(免)	AAA	1.7475
2.19Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A(免)	AAA	1.8025
2.19Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A(免)	AAA	1.8025
2.23Y	2528007.IB	25 浦发银行 01(免)	AAA	1.735
2.23Y	2528007.IB	25 浦发银行 01(免)	AAA	1.735
2.23Y	2528007.IB	25 浦发银行 01(免)	AAA	1.735
2.28Y	2528010.IB	25 农业银行科创债(免)	AA+/AAA	1.725
2.31Y+NY	242380007.IB	23 苏州银行永续债 01(免)	AAA/AA+	1.9
2.32Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01(免)	AAA	1.85
2.43Y+1Y	312510006.IB	25 中行 TLAC 非资本债 01(BC)(免)	AAA	1.825
2.44Y+5Y	232380026.IB	23 厦门国际二级资本债 01(免)	AAA	2.13
2.44Y+5Y	232380026.IB	23 厦门国际二级资本债 01(免)	AAA	2.13
2.44Y+5Y	232380026.IB	23 厦门国际二级资本债 01(免)	AAA	2.13
2.45Y	2520030.IB	25 贵州银行绿色债 01(免)	AAA	1.885
2.57Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A(免)	AAA	1.835
2.63Y	212580027.IB	25 上海银行债 02	AAA	1.7875
2.65Y	212580032.IB	25 建行小微债 01BC	AAA	1.76
2.65Y	212580032.IB	25 建行小微债 01BC	AAA	1.76
2.65Y	212580032.IB	25 建行小微债 01BC	AAA	1.76
2.65Y	212580032.IB	25 建行小微债 01BC	AAA	1.76
2.65Y	212580032.IB	25 建行小微债 01BC	AAA	1.76
2.72Y+5Y	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A(免)	AAA	1.85
2.72Y+5Y	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A(免)	AAA	1.85
2.75Y	212580033.IB	25 厦门国际银行债 02	AAA	1.945
2.75Y	212580033.IB	25 厦门国际银行债 02	AAA	1.94
2.78Y	2528025.IB	25 浦发银行绿色债 01	AAA	1.77
2.79Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A(免)	AAA	1.875
2.79Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A(免)	AAA	1.875
2.79Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A(免)	AAA	1.865
3Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9
3Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A(免)	AAA	1.89
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9025
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9025
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9025
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9025
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9025
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9025
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9025
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9025
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9025
3.01Y+5Y	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A(免)	AAA	1.9
3.01Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A(免)	AA+/AAA	1.895
3.01Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A(免)	AA+/AAA	1.895

3.18Y+5Y(休 1)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A(免)	AAA	1.9175
3.24Y+5Y(休 4)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01(免)	AAA	2.1
3.28Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01(免)	AAA	1.94
3.44Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A(免)	AAA	1.99
3.44Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A(免)	AAA	1.98
3.44Y+5Y	232400029.IB	24 中原银行二级资本债 01(免)	AAA	2.21
3.44Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01(免)	AAA	1.955
3.52Y+5Y(休 1)	232400034.IB	24 杭州银行二级资本债 01(免)	AAA	1.985
3.53Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A(免)	AAA	1.96
3.53Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A(免)	AAA	1.96
3.53Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A(免)	AAA	1.96
3.73Y+5Y(休 1)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC(免)	AAA	1.9775
3.73Y+5Y(休 1)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC(免)	AAA	1.9775
3.85Y+5Y	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A(免)	AAA	2.005
3.85Y+5Y	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A(免)	AAA	2.005
3.91Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC(免)	AAA	2.01
3.91Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC(免)	AAA	2.01
3.91Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC(免)	AAA	2.01
4.05Y+NY	242580002.IB	25 邮储永续债 01BC(免)	AAA	2.075
4.08Y+5Y(休 1)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC(免)	AAA	2.025
4.15Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC(免)	AAA	2.035
4.19Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC(免)	AAA	2.18
4.22Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC(免)	AAA	2.155
4.24Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC(免)	AAA	2.155
4.24Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC(免)	AAA	2.155
4.24Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC(免)	AAA	2.04
4.24Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC(免)	AAA	2.04
4.24Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC(免)	AAA	2.0225
4.29Y+5Y(休 1)	232580009.IB	25 中信银行二级资本债 01BC(免)	AAA	2.06
4.31Y+5Y(休 1)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC(免)	AAA	2.045
4.32Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC(免)	AAA	2.165
4.32Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC(免)	AA+/AAA	2.12
4.32Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC(免)	AA+/AAA	2.1125
4.32Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC(免)	AA+/AAA	2.1125
4.36Y	332580008.IB	25 南京银行科创债 01BC(免)	AAA	1.815
4.36Y+NY	242580018.IB	25 江苏银行永续债 02BC(免)	AAA	2.1875
4.44Y+5Y(休 1)	232580022.IB	25 工行二级资本债 03BC(免)	AAA	2.055
4.44Y+5Y(休 1)	232580022.IB	25 工行二级资本债 03BC(免)	AAA	2.05
4.61Y+NY	242580038.IB	25 兴业银行永续债 02BC	AAA	2.24
4.62Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.235
4.62Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.235
4.62Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.235
4.62Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.235
4.77Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.1875
4.77Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.1875
4.77Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.1825
4.77Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.175

4.78Y+NY	242580048.IB	25 长沙银行永续债 01	AAA	2.395
4.8Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+/AAA	2.11
4.8Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+/AAA	2.115
4.8Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+/AAA	2.105
4.8Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+/AAA	2.105
4.8Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+/AAA	2.105
4.8Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+/AAA	2.11
4.8Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+/AAA	2.11
4.8Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+/AAA	2.11
4.8Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+/AAA	2.11
4.8Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+/AAA	2.11
4.81Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.115
4.81Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.115
4.81Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.1125
4.81Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.1075
4.82Y+NY	242580057.IB	25 杭州银行永续债 02	AAA	2.305
4.82Y+NY	242580057.IB	25 杭州银行永续债 02	AAA	2.3
4.83Y+5Y(休 1)	232580051.IB	25 长沙银行二级资本债 01	AAA	2.3
4.85Y+5Y(休 1)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.1125
4.85Y+5Y(休 1)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.11
4.85Y+5Y(休 1)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.11
4.85Y+5Y(休 1)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.11
4.85Y+5Y(休 1)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.11
4.87Y+5Y(休 1)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.235
4.87Y+5Y(休 1)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.2275
4.87Y+5Y(休 1)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.22
4.87Y+5Y(休 1)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.22
4.87Y+5Y(休 1)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.22
4.87Y+5Y(休 1)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.22
7.84Y+5Y	232380085.IB	23 中行二级资本债 04B(免)	AAA	2.355
8.85Y+5Y(休 1)	232480099.IB	24 浦发银行二级资本债 02B(免)	AAA	2.45

免责声明：本日报由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用日报内容。日报所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，信息不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本日报任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。