

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

【2026-03-03】

国债

今日央行开展 343 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 5260 亿，逆回购口径资金净回笼 4917 亿。

国债方面 1.98Y 250005 1.2875-1.29； 3.90Y 250003 1.4625-1.466； 6.06Y 250007 1.606-1.6125； 9.48Y 250016 1.787-1.7925； 29.48Y 250006 2.2275-2.235。

	1y	3y	5y	7y	10y	30y
昨日国债(%)	1.2350	1.3350	1.5300	1.6510	1.7890	2.2305
今日国债(%)	1.2250	1.3200	1.5275	1.6540	1.7925	2.2345
变动(%)	-0.0100	-0.0150	-0.0025	0.0030	0.0035	0.0040

金融债

金融债方面 322D 260401 1.52-1.535； 2.98Y 240203 1.62-1.625； 5.88Y 220205 1.7775-1.78； 9.29Y 250215 1.93-1.935。

	1y	3y	5y	7y	10y
昨日非国开金融债(%)	1.4950	1.6050	1.6850	1.8575	1.9460
今日非国开金融债(%)	1.4850	1.5950	1.6850	1.8550	1.9465
变动(%)	1.4850	-0.0100	0.0000	-0.0025	0.0005
昨日国开债(%)	1.4750	1.6600	1.6850	1.8375	1.9315
今日国开债(%)	1.4575	1.6500	1.6825	1.8375	1.9340
变动(%)	-0.0175	-0.0100	-0.0025	0.0000	0.0025

银行债

1-3y 大行二级今日成交收益率盘内持续震荡，整体下行 0.5 到 1bp； 1y 大行今开 1.665/1.65，成交在 1.66 (+0.08) 和 1.65 (-0.92)，尾盘收在 1.65/1.63。 2y 大行今开 1.71/1.70，最高成交在 1.71 (-0.23)，最低高成交在 1.70 (-1.23)，尾盘收在 1.705/1.70。今日 1-3y 大行二级交易情绪较清淡，整体今日买盘力量强于卖盘，基金、银行、券商及理财均有参与。

5y 大行二级全天交易较活跃，盘中收益率开盘后大幅跳水，触底反弹后区间内大幅震荡，最后尾盘持续拉升。非免税券昨收 2.04 (+0.47)，今开 2.045 (+0.97)。日内最高 2.0475 (-1.22)，最低 2.0425 (+0.72)，震荡区间 0.5bp，今收 2.0475 (+1.22)，尾盘对峙为 2.049/2.0485。盘中与同期限大行永续相差约 4.75bp，券商基金为主要参与方；

五年 25 工行二级资本债 02BC 昨收 1.97 (-0.02)，今开 1.9702(-0.04)，日内最高 1.975(+0.48)，最低 1.97(-0.02)，今收 1.975(+0.48)，尾盘对峙为 1.985/1.98，市场成交依旧火热；

十年 25 农行二级资本债 03B(BC) 昨收 2.39 (+0.18)，今开 2.3925(+0.43)，最高 2.3925(+0.43)，最低 2.39(+0.18)，今收 2.39(+0.18)，尾盘对峙为 2.40/2.3925；

5y 股份制二永收益先下后上。4.72y 平安永续成交在 2.225 (-0.15) 到 2.235 (+0.85)，震荡区间 1bp。今日股份制二永成交情绪一般，基金，理财，保险有参与。

商金方面，1-3y 大行主要成在 (-1) 到 (+2)。1.57y 24 交行债 02BC 成在 1.63 (-0.77) 到 1.635 (-0.27)。股份制主要成在 (-2) 到 (+0.5)。大城商行今日主要成在 (-2) 到估值 (+0)。2.29y 25 杭州银行 01 成在 1.70 (-1.36)。科创今日主要成在 (-0.5) 到 (+1)。2.23y 25 建行科创债 01A 成在 1.67 (+0.97)。收益率全天动荡。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较好，成交主要集中于 2026Q2 期限。短端方面，86D 012680291.IB 26 电网 SCP007 AAA 成交在 1.6% (-2.5)，银行出给基金；87D 012582131.IB 25 湖南能源 SCP001(科创债) AAA 成交在 1.67% (-1)，基金出给基金。中长端方面，170D 012680358.IB 26 厦国贸 SCP006 AAA 成交在 1.70% (-1.74)，银行出给基金；171D 012680477.IB 26 上海医药 SCP001 AAA 成交在 1.64% (-2.77)，银行出给基金。长端方面，266D 012680499.IB 26 宝钢 SCP002(科创债) AAA 成交在 1.64% (-0.48)，银行出给基金。总体而言，短端、中长端和长端收益日内均小幅下行。

中期票据

今日中票收益早盘在估值-1 左右，尾盘成在估值左右。汇金、电网今日成交活跃度一般，5y 汇金今日在 1.92% (-0.69) 成交。10Y 电网成在 2.24% (-1.00)。

1-3Y，好名字整体成交在估值-3 到估值+2，1.24Y 24 南航股 MTN006 成在 1.7025% (-0.45)，1.96Y 25 沪电力 MTN001 成在 1.78% (-0.35)，2.43Y 25 湘高速 MTN016 成在 1.815% (-2.24)。成交收益率集中在 1.70%-1.90%，基金、银行/基金、保险为主。

3-5Y，好名字整体成交在估值-2 到估值+2，3.64Y 24 中铝 MTN003 成在 1.915% (-0.73)，4.85Y 26 蜀道投资 MTN001 成在 1.98% (-1.19)，4.62Y 25 鲁黄金 MTN010(科创债)成在 1.97% (-0.33)，收益率集中在 1.85%-2.00%，银行/银行为主。

5Y+，9.71Y 25 国新控股 MTN002 成在 2.285% (-1.44)；9.56Y 25 上实 MTN004B 成在 2.375% (-2.10)，成交收益率主要集中在 2.20%-2.35%。

永续中票集中在 2-5Y 的普通名字，成交收益率大概在估值-3/+2，保险、资管/基金为主。

企业债

交易所信用债全天交投非常活跃，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+1 到估值-1 (310D 25 中证 14 1.64)，基金保险买，基金理财卖；非券商债多成交在 1.66-1.74，(328D 22 新际 02 1.70)，基金理财保险买，基金银行卖；年内科创债今日成交较少 (242D 25 大唐 K1 1.68)。

1-3 年，今日券商债成交尚可，成交多在估值-1 附近 (2.94Y 26GTH06 1.80)，基金券商保险买，基金券商银行卖；非券商债成交尚可，多成交在估值附近 (2.62Y 25 深资 01 1.86)，基金理财保险买，基金券商卖。科创债成交较少 (2.93Y(休 1) 26 长电 K1 1.78)。

3-5 年，券商债今日成交多在估值-2 到估值，基金银行券商参与；非券商债方面今日成交较活跃，成交多在估值-2 到估值+1 (3.68Y 24 中化 15 1.87)，基金券商及资管双边参与，保险买，银行卖；科创方面今日成交多在估值-1 到估值+1 (4.94Y+NY 延长 KY26 2.07)，基金券商双边参与，银行券商卖。

5Y+，券商债成交寥寥；非券商债成交寥寥，成交多在估值-0.5 附近 (8.38Y 24 中化 10 2.57)，基金和券商双边参与买卖盘；科创方面亦成交寥寥，多成交在估值-0.5 附近 (9.67Y 25 国新 K1 2.26)，基金双边参与买卖盘。

美元债

周二市场交投主要围绕新发券。城投板块，新发的长春城发 3 年期美元债收窄 10-15bps (一级定价 4.90%)，新发的绍兴上虞 3 年期美元债卖盘维持在 reoffer 附近 (一级定价 3.90%)。地产板块，万科继续下跌 0.25-0.5pt。

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	012581313.IB	25 浙交投 SCP014	AAA	1.6
3D	012582715.IB	25 沪电力 SCP016	AAA	1.61
3D	042580126.IB	25 成都经开 CP002	BBB+	1.6
3D	072510200.IB	25 国信证券 CP011	AAA	1.55
3D	072510200.IB	25 国信证券 CP011	AAA	1.55
3D	072510200.IB	25 国信证券 CP011	AAA	1.6
7D	012582146.IB	25 鄂交投 SCP004	AAA	1.6225
45D	012680110.IB	26 沪电力 SCP001	AAA	1.63
48D	012680182.IB	26 国家能源 SCP001	AAA	1.61
50D	012582564.IB	25 江西交投 SCP006	AAA	1.66
66D	012581951.IB	25 中广核租 SCP004(绿色)	AA+	1.69
80D	012582319.IB	25 东航股 SCP009	AAA	1.635
86D	012680291.IB	26 电网 SCP007	AAA	1.6
87D	012582131.IB	25 湖南能源 SCP001(科创债)	AAA	1.67
87D	012680509.IB	26 南通沿海 SCP002	A	1.66
87D	012680509.IB	26 南通沿海 SCP002	A	1.66
87D	012680509.IB	26 南通沿海 SCP002	A	100.00 净价
139D	012680208.IB	26 九州通 SCP001(科创债)	BBB+	1.69
164D	012680033.IB	26 京水投 SCP001	AA+	1.68
169D	042580423.IB	25 三峡文旅 CP002	AA	1.89
170D	012680358.IB	26 厦国贸 SCP006	AAA	1.7
170D	012680358.IB	26 厦国贸 SCP006	AAA	1.7
171D	012680477.IB	26 上海医药 SCP001	AAA	1.64
172D(休 2)	012680060.IB	26 供销 SCP001	AAA	1.7
174D	012582896.IB	25 厦门海翼 SCP001	AA+	1.7

174D	012582896.IB	25 厦门海翼 SCP001	AA+	1.7
175D	012680480.IB	26 万华化学 SCP002(科创债)	AAA	1.67
175D	012680480.IB	26 万华化学 SCP002(科创债)	AAA	1.67
176D	012680494.IB	26 江西交投 SCP002	AAA	1.65
176D	012680494.IB	26 江西交投 SCP002	AAA	1.65
207D(休 2)	042580519.IB	25 电网 CP003	AAA	1.64
239D	012680511.IB	26 闽投 SCP001	AAA	1.65
239D	012680511.IB	26 闽投 SCP001	AAA	1.65
248D	012680398.IB	26 厦门信息 SCP001	AA+	1.73
248D	012680398.IB	26 厦门信息 SCP001	AA+	1.73
266D	012680492.IB	26 华发集团 SCP002	AAA	2.52
266D	012680495.IB	26 金川 SCP001(科创债)	AAA	1.68
266D	012680495.IB	26 金川 SCP001(科创债)	AAA	1.68
266D	012680495.IB	26 金川 SCP001(科创债)	AAA	1.68
266D	012680499.IB	26 宝钢 SCP002(科创债)	AAA	1.64
266D	012680499.IB	26 宝钢 SCP002(科创债)	AAA	1.64
329D	072610020.IB	26 方正证券 CP001	AAA	1.7

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（%）
3D	102380391.IB	23 嘉兴城投 MTN001	AAA	1.64
14D	102380573.IB	23 张家国资 MTN002	AAA	1.61
22D	102581128.IB	25 湘高速 MTN003	AAA	1.62
45D+NY	102380901.IB	23 大唐新能 MTN001	AAA	1.7 行权
66D	102381148.IB	23 青岛国信 MTN003	AAA	1.67
70D	102100962.IB	21 川铁投 MTN005	AAA	1.67
132D	102381655.IB	23 新海连 MTN002	AA+	1.73
132D	102381655.IB	23 新海连 MTN002	AA+	1.73
136D+NY	102381689.IB	23 陕西交通 MTN001	AAA	1.74 行权
136D+NY	102381689.IB	23 陕西交通 MTN001	AAA	1.74 行权
147D	102101401.IB	21 谷财 MTN002	AA	1.72
161D+2Y	102382028.IB	23 衡阳城投 MTN004	AA+	1.70 行权
181D+1.99Y	102382301.IB	23 乐山国资 MTN003	AA+	1.72 行权
185D+NY	102382356.IB	23 中建八局 MTN001(科创票据)	AAA	1.75 行权
185D+NY	102382356.IB	23 中建八局 MTN001(科创票据)	AAA	1.75 行权
185D+NY	102382356.IB	23 中建八局 MTN001(科创票据)	AAA	1.75 行权
289D	102485444.IB	24 中石化 MTN003	AAA	1.62
289D	102485444.IB	24 中石化 MTN003	AAA	1.62
308D+2Y	102400001.IB	24 莫干山 MTN001	AA+	1.73 行权
309D	102280008.IB	22 科学城 MTN001B	AAA	1.7
311D+2Y	102480050.IB	24 赣州城投 MTN001	AA+	1.72 行权
322D	102280122.IB	22 中信集团 MTN001A	AAA	1.65
336D	102480446.IB	24 西江 MTN001	AA+	1.79
336D	102480446.IB	24 西江 MTN001	AA+	1.79
1.06Y	102581353.IB	25 武清经开 MTN004	AA+	1.89
1.06Y	102481190.IB	24 盐城城南 MTN002	AA+	1.72
1.06Y+NY	102581354.IB	25 中电投 MTN009	AAA	1.74 行权
1.07Y(休 1)	102481262.IB	24 胶州城投 MTN001	AA+	1.76
1.14Y	102481650.IB	24 淮南建发 MTN001	AA+	1.82
1.15Y	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA	1.66
1.23Y	102482065.IB	24 南航股 MTN004	AAA	1.72
1.24Y(休 1)	102482100.IB	24 南航股 MTN006	AAA	1.7025
1.29Y	102281302.IB	22 长沙轨交 MTN001	AAA	1.71

1.33Y(休 2)	102582698.IB	25 新华发行 MTN001	AA+	1.87
1.39Y(休 1)	102483174.IB	24 深业 MTN003	AAA	1.84
1.39Y(休 1)	102483174.IB	24 深业 MTN003	AAA	1.84
1.49Y(休 2)	102483804.IB	24 圆通蛟龙 MTN002	AA+	1.89
1.49Y(休 2)	102483830.IB	24 保定长城 MTN001	AAA	1.88
1.49Y(休 2)	102483857.IB	24 电网 MTN001	AAA	1.71
1.49Y(休 2)	102483857.IB	24 电网 MTN001	AAA	1.71
1.49Y(休 2)	102483860.IB	24 电网 MTN003	AAA	1.71
1.49Y(休 2)	102483860.IB	24 电网 MTN003	AAA	1.71
1.62Y	102484397.IB	24 吴中城投 MTN005	AA+	1.79
1.67Y	102282449.IB	22 豫交投 MTN002B	AAA	1.76
1.67Y+NY	102501677.IB	25 京城建 MTN005A	AAA	1.97 行权
1.74Y(休 1)	102585019.IB	25 汇金 MTN007	AAA	1.73
1.74Y(休 1)	102585019.IB	25 汇金 MTN007	AAA	1.73
1.78Y+NY(休 1)	102585167.IB	25 鲁西矿业 MTN001	AAA	2 行权
1.8Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.735
1.8Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.74
1.8Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.74
1.82Y+NY	102585373.IB	25 信达 MTN001	BBB	3.35 行权
1.87Y	102580351.IB	25 邮政 MTN001	AAA	1.75
1.95Y(休 1)	102580525.IB	25 中广核 MTN001(科创票据)	AAA	1.755
1.95Y(休 1)	102580525.IB	25 中广核 MTN001(科创票据)	AAA	1.755
1.97Y(休 1)	102580675.IB	25 中国水务 MTN001BC	AA+	3.07
1.99Y	102300295.IB	23 临沂城发 MTN001	AA+	1.88
1.99Y	102300295.IB	23 临沂城发 MTN001	AA+	1.88
1.99Y	102300295.IB	23 临沂城发 MTN001	AA+	1.9
1.99Y	102300295.IB	23 临沂城发 MTN001	AA+	1.9
2.07Y	102581434.IB	25 南投集团 MTN001	AA+	1.91
2.12Y+NY	102501324.IB	25 郑州高新 MTN001	AA+	2.05 行权
2.16Y+3Y	102581937.IB	25 国贸地产 MTN001	AA+	2.25 行权
2.22Y	102582113.IB	25 越秀租赁 MTN002A	AAA	1.9
2.27Y+2Y(休 1)	102582280.IB	25 宜昌高新 MTN001	AA+	1.89 行权
2.34Y	102582712.IB	25 荣盛 MTN001(科创债)	AAA	2.05
2.34Y	102582712.IB	25 荣盛 MTN001(科创债)	AAA	2.05
2.36Y+NY	102300398.IB	23 沪建工 MTN001	AAA	2.05 行权
2.36Y+NY	102300398.IB	23 沪建工 MTN001	AAA	2.05 行权
2.37Y(休 2)	102582895.IB	25 云铜股 MTN001(科创债)	AAA	1.9
2.37Y(休 2)	102582895.IB	25 云铜股 MTN001(科创债)	AAA	1.9
2.39Y	102583060.IB	25 江西交投 MTN003	AAA	1.8
2.39Y	102583060.IB	25 江西交投 MTN003	AAA	1.8
2.5Y	102583734.IB	25 中交资本 MTN001	AAA	2.02
2.5Y	102583734.IB	25 中交资本 MTN001	AAA	2.02
2.64Y	102382821.IB	23 川发展 MTN003	AAA	1.81
2.67Y	102584592.IB	25 株国投 MTN003A	AA+	2.05
2.85Y	102680080.IB	26 津城建 MTN001	AAA	2.045
2.86Y	102480139.IB	24 陕延油 MTN001	AAA	1.83
2.86Y	102480139.IB	24 陕延油 MTN001	AAA	1.83
2.86Y	102680119.IB	26 国耀融汇 MTN002	AAA	2.35
2.89Y	102680289.IB	26 海淀国资 MTN001A	AAA	2
2.89Y	102680289.IB	26 海淀国资 MTN001A	AAA	2
2.9Y	102680321.IB	26 赣国资 MTN001(科创债)	AAA	1.85
2.94Y(休 10)	102680547.IB	26 江苏港口 MTN001	AAA	1.88
2.95Y+2Y	102680594.IB	26 良渚文化 MTN001	AA+	1.92 行权
2.95Y+2Y	102680594.IB	26 良渚文化 MTN001	AA+	1.92 行权
2.95Y+2Y	102680594.IB	26 良渚文化 MTN001	AA+	1.92 行权

2.95Y+2Y	102680594.IB	26 良渚文化 MTN001	AA+	1.92 行权
3.05Y	102680305.IB	26 晋能煤业 MTN001(科创债)	AAA	2.11
3.14Y	102581813.IB	25 湘高速 MTN007	AAA	1.87
3.44Y(休 1)	102483469.IB	24 华电股 MTN004B	AAA	1.855
3.45Y	102483560.IB	24 邮政 MTN004	AAA	1.855
3.49Y+NY	102400930.IB	24 河钢集 MTN014	AAA	2.43 行权
3.51Y	101901217.IB	19 京基投 MTN001A	AAA	1.875
3.68Y	102484849.IB	24 京国资 MTN006	AAA	1.895
3.72Y	102485009.IB	24 浙能源 MTN005	AAA	1.88
3.74Y	102485171.IB	24 国新控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	1.89
3.74Y	102485173.IB	24 诚通控股 MTN014(稳增长扩投资专项债)	AAA	1.91
3.74Y	102485173.IB	24 诚通控股 MTN014(稳增长扩投资专项债)	AAA	1.91
3.95Y+NY	102580512.IB	25 首钢 MTN001B	AAA	2.14 行权
3.98Y(休 1)	102580743.IB	25 汇金 MTN001	AAA	1.9
3.98Y(休 1)	102580743.IB	25 汇金 MTN001	AAA	1.9
4.03Y+5Y	102581120.IB	25 济南能源 MTN001	AAA	2.06 行权
4.08Y	102581480.IB	25 太湖新城 MTN001	AAA	1.96
4.27Y	102582354.IB	25 深圳安居 MTN001	AAA	2.03
4.38Y(休 2)	102580397.IB	25 电网 MTN010	AAA	1.915
4.39Y	102580451.IB	25 电网 MTN014	AAA	1.92
4.75Y+2Y	102501750.IB	25 济南高新 MTN010B	AAA	2.27 行权
4.85Y	102680090.IB	26 蜀道投资 MTN001	AAA	1.98
4.85Y	102680090.IB	26 蜀道投资 MTN001	AAA	1.98
4.85Y	102680090.IB	26 蜀道投资 MTN001	AAA	1.98
4.85Y	102680090.IB	26 蜀道投资 MTN001	AAA	1.98
4.85Y	102680090.IB	26 蜀道投资 MTN001	AAA	1.98
5.9Y	102680346.IB	26 电网 MTN002(科创债)	AAA	1.98
7.84Y	102480020.IB	24 锡交通 MTN002	AAA	2.35
8.34Y	102482881.IB	24 光大集团 MTN004B	AAA	2.24
9.06Y	102581378.IB	25 电网 MTN015	AAA	2.235
9.32Y	102582669.IB	25 皖能源 MTN006(科创债)	AAA	2.3
9.33Y	102582692.IB	25 上实 MTN003	AAA	2.36
9.54Y(休 2)	102583864.IB	25 光大集团 MTN006B	AAA	2.28
9.54Y(休 2)	102583864.IB	25 光大集团 MTN006B	AAA	2.29
14.31Y(休 1)	102582573.IB	25 电网 MTN023	AAA	2.36

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（%）
10D	2320008.IB	23 郑州银行 01	AAA	1.55
10D	2320008.IB	23 郑州银行 01	AAA	1.55
28D+NY	2120022.IB	21 齐鲁银行永续债	AAA	1.58 行权
28D+NY	2120022.IB	21 齐鲁银行永续债	AAA	1.58 行权
28D+NY	2120022.IB	21 齐鲁银行永续债	AAA	1.58 行权
41D	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	1.56
64D+5Y	2120040.IB	21 红塔银行二级 01	AA+	1.76 行权
10D	2320008.IB	23 郑州银行 01	AAA	1.55
10D	2320008.IB	23 郑州银行 01	AAA	1.55
28D+NY	2120022.IB	21 齐鲁银行永续债	AAA	1.58 行权
28D+NY	2120022.IB	21 齐鲁银行永续债	AAA	1.58 行权
28D+NY	2120022.IB	21 齐鲁银行永续债	AAA	1.58 行权
41D	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	1.56
64D+5Y	2120040.IB	21 红塔银行二级 01	AA+	1.76 行权

105D+NY	2121026.IB	21 杭州联合农商永续债 01	AAA	1.66 行权
131D(休 1)	2320026.IB	23 徽商银行	AAA	1.6
146D+5Y(休 1)	2120066.IB	21 邢台银行二级 01	AA+	2.26 行权
146D+5Y(休 1)	2120066.IB	21 邢台银行二级 01	AA+	2.26 行权
174D+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	1.63 行权
174D	2328021.IB	23 兴业银行小微债 01	AAA	1.57
230D+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	1.65 行权
230D+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	1.65 行权
256D(休 2)	2320056.IB	23 广州银行绿色债 02	AAA	1.61
258D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.63 行权
258D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.63 行权
267D+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	1.64 行权
272D+NY(休 1)	2128045.IB	21 中国银行永续债 02	AAA	1.63 行权
286D+5Y(休 1)	2128049.IB	21 建设银行二级 05	AAA	1.635 行权
286D+5Y(休 1)	2128049.IB	21 建设银行二级 05	AAA	1.635 行权
315D+4Y(休 1)	292680002.IB	26 巴克莱银行债 01B(BC)	--/--	2.16 行权
317D+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	1.64 行权
317D+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	1.645 行权
327D+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.64 行权
356D+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AA+	1.65 行权
359D+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	1.64 行权
359D+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	1.65 行权
1.01Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	1.65 行权
1.03Y	2420008.IB	24 江苏银行绿色债 01	AAA	1.605
1.03Y	2420009.IB	24 江苏银行绿色债 02	AAA	1.605
1.11Y(休 1)	212480009.IB	24 上海银行债 01	AAA	1.625
1.11Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	1.66 行权
1.11Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	1.66 行权
1.14Y(休 1)	212400004.IB	24 光大银行小微债	AAA	1.6
1.15Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	AAA	1.66 行权
1.23Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	1.62
1.23Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	1.63
1.23Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	1.63
1.23Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	1.63
1.23Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	1.63
1.23Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	1.63
1.23Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	1.63
1.23Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	1.63
1.33Y(休 2)	102582698.IB	25 新华发行 MTN001	AA+	1.87
1.36Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.615
1.36Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.615
1.43Y(休 1)	212480018.IB	24 湖南银行债 01	AAA	1.705
1.44Y+1Y(休 2)	312410003.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.69 行权
1.44Y+1Y(休 2)	312410003.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.69 行权
1.44Y+1Y(休 2)	312410003.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.69 行权
1.44Y+1Y(休 2)	312410003.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.69 行权
1.47Y+5Y(休 1)	092280065.IB	22 工行二级资本债 03A	AAA	1.6925 行权
1.47Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	1.62
1.57Y	2428004.IB	24 中国银行三农债 01	AAA	1.625
1.57Y+5Y	092280098.IB	22 杭州银行二级资本债 01	AAA	1.72 行权
1.64Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	1.77 行权
1.64Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	1.77 行权
1.64Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	1.77 行权
1.64Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	1.77 行权
1.69Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	1.70 行权
1.89Y(休 1)	2528001.IB	25 农业银行三农债 01	AA+	1.66

1.89Y(休 1)	2528001.IB	25 农业银行三农债 01	AA+	1.66
1.96Y	212580001.IB	25 浙商银行债 01A	AAA	1.6925
2.05Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.735 行权
2.05Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.735 行权
2.1Y(休 2)	212580007.IB	25 浙商银行小微债 01BC	AAA	1.7
2.15Y	2528007.IB	25 浦发银行 01	AAA	1.685
2.2Y(休 1)	2528009.IB	25 浦发银行科创债 01	AAA	1.68
2.2Y(休 1)	2528009.IB	25 浦发银行科创债 01	AAA	1.68
2.22Y(休 1)	2528014.IB	25 平安银行小微债 01	AAA	1.71
2.22Y(休 1)	2528014.IB	25 平安银行小微债 01	AAA	1.71
2.22Y+5Y	092303003.IB	23 进出口行二级资本债 01	--/--	1.77 行权
2.22Y+5Y	092303003.IB	23 进出口行二级资本债 01	--/--	1.77 行权
2.22Y+5Y	092303003.IB	23 进出口行二级资本债 01	--/--	1.77 行权
2.29Y+1Y(休 3)	312510001.IB	25 交行 TLAC 非资本债 01A(BC)	AAA	1.755 行权
2.35Y	2521004.IB	25 上海农商绿色债 01	AAA	1.69
2.48Y+5Y	232380033.IB	23 成都银行二级资本债 01	AAA	1.83 行权
2.49Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.77 行权
2.49Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.78 行权
2.49Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.78 行权
2.49Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.78 行权
2.49Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.78 行权
2.49Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.78 行权
2.49Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.785 行权
2.49Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.785 行权
2.55Y	212580027.IB	25 上海银行债 02	AAA	1.73
2.55Y	212580027.IB	25 上海银行债 02	AAA	1.735
2.55Y	212580027.IB	25 上海银行债 02	AAA	1.735
2.55Y	212580027.IB	25 上海银行债 02	AAA	1.735
2.57Y	212580032.IB	25 建行小微债 01BC	AAA	1.7
2.57Y	212580032.IB	25 建行小微债 01BC	AAA	1.7
2.57Y	212580032.IB	25 建行小微债 01BC	AAA	1.7
2.64Y+5Y(休 1)	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A	AAA	1.795 行权
2.7Y+1Y	312510014.IB	25 交行 TLAC 非资本债 03A(BC)	AAA	1.83 行权
2.79Y+5Y	232380088.IB	23 苏州银行二级 01	AAA	1.87 行权
2.8Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	1.815 行权
2.8Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	1.815 行权
2.81Y	212580057.IB	25 江苏银行债 04BC	AAA	1.74
2.93Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	1.97 行权
2.93Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.825 行权
3.04Y+5Y(休 1)	1928003.IB	19 农业银行二级 01	AA+	1.845 行权
3.04Y+5Y(休 1)	1928003.IB	19 农业银行二级 01	AA+	1.845 行权
3.04Y+5Y(休 1)	1928003.IB	19 农业银行二级 01	AA+	1.845 行权
3.11Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AA+	1.85 行权
3.11Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AA+	1.85 行权
3.11Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AA+	1.85 行权
3.15Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AA+	1.85 行权
3.15Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AA+	1.85 行权
3.15Y+5Y	1928012.IB	19 工商银行二级 04	AAA	1.845 行权
3.15Y+5Y	1928012.IB	19 工商银行二级 04	AAA	1.845 行权
3.16Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.05 行权
3.16Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.05 行权
3.16Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	1.8575 行权
3.16Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	1.86 行权
3.16Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	1.86 行权
3.16Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	1.86 行权

3.2Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.90 行权
3.2Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.90 行权
3.2Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.90 行权
3.25Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	1.95 行权
3.27Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	1.96 行权
3.27Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	1.96 行权
3.27Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	1.96 行权
3.29Y+5Y(休 2)	232400022.IB	24 成都银行二级资本债 01	AAA	1.95 行权
3.29Y+5Y(休 2)	232400022.IB	24 成都银行二级资本债 01	AAA	1.95 行权
3.3Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.96 行权
3.3Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.96 行权
3.3Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.96 行权
3.3Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.96 行权
3.3Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	1.96 行权
3.4Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	1.8825 行权
3.41Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	1.9 行权
3.42Y+5Y(休 2)	232400032.IB	24 成都银行二级资本债 02	AAA	1.975 行权
3.42Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	1.925 行权
3.42Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	1.925 行权
3.45Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	1.87 行权
3.45Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	1.87 行权
3.45Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	1.895 行权
3.45Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	1.90 行权
3.45Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	1.90 行权
3.45Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	1.90 行权
3.48Y+NY(休 1)	242400019.IB	24 江苏银行永续债 02	AAA	1.985 行权
3.48Y+NY(休 1)	242400019.IB	24 江苏银行永续债 02	AAA	1.99 行权
3.49Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	1.91 行权
3.49Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	1.91 行权
3.49Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.89 行权
3.49Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.89 行权
3.49Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.89 行权
3.49Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.8925 行权
3.49Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.895 行权
3.49Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.895 行权
3.49Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.895 行权
3.56Y+5Y(休 1)	1928029.IB	19 中国银行二级 02	AAA	1.9025 行权
3.56Y+5Y(休 1)	1928029.IB	19 中国银行二级 02	AAA	1.9025 行权
3.65Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	1.9175 行权
3.68Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	1.98 行权
3.68Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	1.98 行权
3.68Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	1.98 行权
3.68Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	1.98 行权
3.68Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	1.98 行权
3.74Y+NY	242480082.IB	24 农行永续债 03BC	AA+	1.955 行权
3.77Y+5Y(休 1)	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A	AAA	1.93 行权
3.77Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	AAA	1.9575 行权
3.77Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	AAA	1.9575 行权
3.77Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	AAA	1.9575 行权
3.83Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.935 行权
3.83Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.935 行权
3.83Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.9375 行权
3.83Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.9375 行权
3.83Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.9375 行权
3.83Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.9375 行权

3.89Y	2528002.IB	25 农业银行三农债 02	AA+	1.76
4Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	1.955 行权
4Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	1.955 行权
4Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	1.96 行权
4.01Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	2.09 行权
4.07Y+5Y	232580003.IB	25 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.995 行权
4.07Y+5Y	232580003.IB	25 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.995 行权
4.07Y+5Y	232580003.IB	25 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.995 行权
4.14Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC	AAA	2.05 行权
4.14Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC	AAA	2.05 行权
4.15Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	2.17 行权
4.15Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	2.17 行权
4.15Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	2.17 行权
4.16Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.05 行权
4.16Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.05 行权
4.16Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.05 行权
4.16Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.05 行权
4.16Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.06 行权
4.16Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	1.9725 行权
4.21Y+5Y(休 2)	232580009.IB	25 中信银行二级资本债 01BC	AAA	1.98 行权
4.21Y+5Y(休 2)	232580009.IB	25 中信银行二级资本债 01BC	AAA	1.98 行权
4.21Y+5Y(休 2)	232580009.IB	25 中信银行二级资本债 01BC	AAA	1.98 行权
4.21Y+5Y(休 2)	232580009.IB	25 中信银行二级资本债 01BC	AAA	1.985 行权
4.21Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.02 行权
4.21Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.02 行权
4.21Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.02 行权
4.21Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.085 行权
4.21Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.085 行权
4.21Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.085 行权
4.23Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	1.98 行权
4.24Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC	AAA	2.06 行权
4.24Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC	AAA	2.06 行权
4.28Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.07 行权
4.28Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.07 行权
4.28Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.07 行权
4.28Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.07 行权
4.28Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.07 行权
4.28Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.07 行权
4.29Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AA+	1.985 行权
4.36Y+5Y(休 2)	232580022.IB	25 工行二级资本债 03BC	AAA	1.9925 行权
4.36Y+5Y(休 2)	232580022.IB	25 工行二级资本债 03BC	AAA	1.9925 行权
4.39Y+5Y	232580028.IB	25 顺德农商二级资本债 01	AAA	2.14 行权
4.39Y+5Y	232580028.IB	25 顺德农商二级资本债 01	AAA	2.14 行权
4.39Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.0475 行权
4.39Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.05 行权
4.39Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.05 行权
4.39Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	1.995 行权
4.39Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	1.995 行权
4.39Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	1.995 行权
4.47Y+NY	242580034.IB	25 成都银行永续债 01	AAA	2.2625 行权
4.47Y+NY	242580034.IB	25 成都银行永续债 01	AAA	2.265 行权
4.47Y+NY	242580034.IB	25 成都银行永续债 01	AAA	2.265 行权
4.48Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.09 行权
4.48Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.09 行权
4.48Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.09 行权

4.48Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.09 行权
4.48Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.09 行权
4.53Y+NY	242580038.IB	25 兴业银行永续债 02BC	AAA	2.14 行权
4.55Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.145 行权
4.55Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.15 行权
4.55Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.0425 行权
4.55Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.0425 行权
4.55Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.045 行权
4.55Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.045 行权
4.63Y+5Y(休 2)	232580038.IB	25 苏州银行二级资本债 01	AAA	2.19 行权
4.63Y+5Y(休 2)	232580038.IB	25 苏州银行二级资本债 01	AAA	2.19 行权
4.72Y+5Y	232580044.IB	25 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.10 行权
4.72Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+	2.0525 行权
4.72Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+	2.0525 行权
4.72Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+	2.0525 行权
4.72Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+	2.055 行权
4.72Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+	2.055 行权
4.72Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.23 行权
4.73Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.055 行权
4.75Y+5Y	232580053.IB	25 成都农商行二级资本债 01	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y	232580053.IB	25 成都农商行二级资本债 01	AAA	2.205 行权
4.78Y+NY	242580063.IB	25 上海银行永续债 01	AAA	2.225 行权
4.78Y+NY	242580063.IB	25 上海银行永续债 01	AAA	2.225 行权
4.79Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.15 行权
4.79Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.15 行权
4.81Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.055 行权
4.81Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.055 行权
4.81Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.055 行权
5.47Y+5Y(休 2)	2128029.IB	21 邮储银行二级 02	AAA	2.11 行权
5.78Y+5Y(休 1)	2128050.IB	21 建设银行二级 06	AAA	2.14 行权
5.78Y+5Y(休 1)	2128050.IB	21 建设银行二级 06	AAA	2.14 行权
5.78Y+5Y(休 1)	2128050.IB	21 建设银行二级 06	AAA	2.14 行权
5.78Y+5Y(休 1)	2128050.IB	21 建设银行二级 06	AAA	2.14 行权
5.78Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.145 行权
5.78Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.145 行权
5.78Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.145 行权
5.78Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.145 行权
5.78Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.145 行权
5.78Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.145 行权
5.78Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.145 行权
5.78Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.145 行权
5.78Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.145 行权
5.88Y+5Y	2228005.IB	22 工商银行二级 02	AAA	2.155 行权
5.88Y+5Y	2228005.IB	22 工商银行二级 02	AAA	2.155 行权
6.3Y+5Y(休 1)	2228042.IB	22 农业银行二级 02	AA+	2.195 行权
6.3Y+5Y(休 1)	2228042.IB	22 农业银行二级 02	AA+	2.195 行权
7.2Y+5Y(休 2)	232300009.IB	23 邮储银行二级资本债 01	AAA	2.25 行权
7.2Y+5Y(休 2)	232300009.IB	23 邮储银行二级资本债 01	AAA	2.25 行权
7.2Y+5Y(休 2)	232300009.IB	23 邮储银行二级资本债 01	AAA	2.25 行权
7.2Y+5Y(休 2)	232300009.IB	23 邮储银行二级资本债 01	AAA	2.25 行权
8.42Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA	2.375 行权
8.42Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA	2.375 行权
8.42Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA	2.38 行权
8.77Y+5Y(休 2)	232480099.IB	24 浦发银行二级资本债 02B	AAA	2.38 行权
9.55Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AA+	2.39 行权
9.55Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AA+	2.39 行权
9.55Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AA+	2.39 行权

9.55Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AA+	2.39 行权
23D	175895.SH	21 世控 02	AAA	1.73
27D	152804.SH	21 上投 01	AAA	1.67
52D	115301.SH	23 华福 C1	AAA	1.6
52D	250919.SH	23 惠安 01	AA+	1.82
55D+2Y	115334.SH	23 诚通 07	AAA	1.70 行权
55D+2Y	115334.SH	23 诚通 07	AAA	1.70 行权
82D(休 1)	115403.SH	23 东证 04	AAA	1.61
83D	032380472.IB	23 常德城投 PPN007	AA+	1.71
96D(休 1)	524602.SZ	25TCLDK	AAA	1.72
96D(休 1)	524602.SZ	25TCLDK	AAA	1.72
96D(休 1)	524602.SZ	25TCLDK	AAA	1.72
101D	133540.SZ	23 岳建 02	AAA	1.7
128D	188363.SH	21 中证 10	AAA	1.59
138D(休 1)	251681.SH	23 通湾 02	AA	1.75
157D	133602.SZ	23 岳建 03	AAA	1.71
159D(休 1)	1980228.IB	19 玉山控股债 02	AA	1.88
159D(休 1)	1980228.IB	19 玉山控股债 02	AA	1.88
159D(休 1)	1980228.IB	19 玉山控股债 02	AA	1.88
192D	115886.SH	23 吉利 K1	AAA	1.7
204D	259975.SH	25 阜投 D4	AA+	1.71
205D	032580624.IB	25 大足发展 PPN004	AA+	1.92
229D(休 1)	032400928.IB	24 溧水经开 PPN006	AA+	1.75
231D	280364.SH	25 镇交 D2	AA+	1.73
231D	280364.SH	25 镇交 D2	AA+	1.73
235D(休 2)	148484.SZ	23 广发 09	AAA	1.62
236D(休 1)	241784.SH	24 安租 09	AAA	1.73
241D+2Y	240147.SH	23 动能 03	AAA	1.75 行权
241D+2Y	240147.SH	23 动能 03	AAA	1.75 行权
267D	032580770.IB	25 海尔租赁 PPN004	AAA	100.1228 净价
269D	133717.SZ	23 闽金 02	AAA	1.7
269D	133717.SZ	23 闽金 02	AAA	1.7
277D(休 2)	292380009.IB	23 德银股份债 02	AAA	1.81
290D	253292.SH	23 明光 02	AA	1.9
292D(休 1)	184170.SH	21 皖交 02	AAA	1.67
297D+2Y	133739.SZ	23 正方 02	AA+	1.89 行权
308D+2Y	253529.SH	24 鹿城 01	AA+	1.73 行权
317D+NY	244519.SH	26 安租 Y1	AAA	2.1 行权
318D	281198.SH	26 镇交 D1	AA+	1.73
344D(休 5)	281719.SH	26 泰城 D1	AAA	1.74
347D(休 2)	032580099.IB	25 巨峰科技 PPN002	AA	2.32
1.01Y+NY(休 1)	148628.SZ	24 深能 Y1	AAA	1.71 行权
1.01Y+NY(休 1)	148628.SZ	24 深能 Y1	AAA	1.71 行权
1.01Y+NY(休 1)	148628.SZ	24 深能 Y1	AAA	1.72 行权
1.04Y+5Y	2223002.IB	22 工银安盛人寿	AAA	1.70 行权
1.04Y+5Y	2223002.IB	22 工银安盛人寿	AAA	1.70 行权
1.04Y	254135.SH	24 黔资 01	AAA	1.76
1.04Y	254135.SH	24 黔资 01	AAA	1.76
1.05Y	032480281.IB	24 江北建投 PPN001	AAA	1.74
1.07Y(休 2)	254216.SH	24 巴中 01	AA+	2.21
1.08Y+2Y	271136.SH	24 钟投债	AA	1.87 行权
1.12Y+2Y	254556.SH	24 长集 01	AA+	1.77 行权
1.14Y	148711.SZ	24 广发 06	AAA	1.66
1.14Y(休 2)	242856.SH	25 穗港 01	AAA	1.73
1.14Y(休 2)	242856.SH	25 穗港 01	AAA	1.73

1.36Y+NY(休 1)	185388.SH	22 华泰 Y2	AAA	1.71 行权
1.36Y+5Y	184478.SH	G22 武侯	AA+	1.76 行权
1.38Y	194974.SH	22 泉丰 01	AA	2.96
1.51Y+1Y	032380834.IB	23 台山公用 PPN002A	AA	1.93 行权
1.54Y	137791.SH	22 安租 18	AAA	2.01
1.57Y+2Y(休 9)	2280428.IB	22 温高新债 01	AA	1.80 行权
1.61Y	2080295.IB	20 濂溪城投债	AA	1.85
1.67Y	133349.SZ	22 惠交债	A	1.82
1.72Y(休 1)	241955.SH	24 东证 08	AAA	1.72
1.75Y(休 2)	256712.SH	24 住开 01	AA	2.53
1.8Y+NY	244452.SH	中化 Y14	AAA	1.87 行权
1.8Y+NY	244452.SH	中化 Y14	AAA	1.87 行权
1.81Y	256927.SH	24 余城 04	AAA	1.86
1.89Y(休 1)	032580080.IB	25 无锡君来 PPN001	AA+	1.99
1.95Y(休 2)	281771.SH	26 新惠 01	AA	2.37
1.97Y	138956.SH	23 陕资 02	AAA	1.98
1.97Y+1Y	240604.SH	24 泰达 01	AAA	2.10 行权
2.11Y+NY	524208.SZ	25 河钢 Y2	AAA	2.04 行权
2.15Y	2522004.IB	25 建信金租债 02	AAA	1.77
2.26Y+NY	148309.SZ	23 广发 Y4	AAA	1.88 行权
2.26Y+NY	243077.SH	鲁资 KY02	AAA	1.91 行权
2.29Y+NY	115495.SH	23 豫通 Y2	AAA	1.87 行权
2.29Y+NY	115495.SH	23 豫通 Y2	AAA	1.87 行权
2.32Y	524343.SZ	25 山路 K1	AAA	1.89
2.38Y	243328.SH	25 建租 K2	AAA	2
2.55Y	524441.SZ	25 华股 02	AAA	1.84
2.56Y(休 1)	243862.SH	25 中证 G5	AAA	1.78
2.56Y(休 1)	243862.SH	25 中证 G5	AAA	1.78
2.56Y(休 1)	243862.SH	25 中证 G5	AAA	1.78
2.56Y+2Y	280116.SH	25 湖城 02	AAA	1.96 行权
2.62Y	280380.SH	25 肥西 01	AA+	2.03
2.62Y	280380.SH	25 肥西 01	AA+	2.03
2.65Y+2Y(休 1)	243996.SH	25 昌投 G1	AA+	2.05 行权
2.65Y+2Y(休 1)	243996.SH	25 昌投 G1	AA+	2.05 行权
2.65Y	244050.SH	25 中证 11	AAA	1.78
2.65Y	524494.SZ	25 山路 01	AAA	1.93
2.67Y(休 2)	117242.SZ	25 成大 E1	AA+	119.50 净价
2.68Y+NY	244122.SH	中粮 YK01	AAA	1.84 行权
2.69Y+2Y	259545.SH	25 邕投 01	AA+	2.42 行权
2.7Y	148504.SZ	23 重发 K1	AAA	1.82
2.7Y	148504.SZ	23 重发 K1	AAA	1.82
2.76Y	244086.SH	25 华泰 15	AAA	1.78
2.8Y	244440.SH	25 红证 06	AAA	1.94
2.81Y+2Y	244463.SH	25 株发 05	AA+	1.97 行权
2.85Y+NY(休 2)	244473.SH	26 厦贸 Y1	AAA	2.35 行权
2.85Y+2Y	281237.SH	26 莫控 01	A-	2.115 行权
2.89Y(休 1)	244589.SH	26 华泰 C1	AAA	1.89
2.89Y(休 1)	244589.SH	26 华泰 C1	AAA	1.89
2.9Y	244611.SH	26 银河 G2	AAA	1.8
2.9Y	244611.SH	26 银河 G2	AAA	1.8
2.9Y	244611.SH	26 银河 G2	AAA	1.8
2.9Y	244611.SH	26 银河 G2	AAA	1.8
2.9Y	244611.SH	26 银河 G2	AAA	1.8
2.9Y	244611.SH	26 银河 G2	AAA	1.8
2.93Y(休 1)	244675.SH	26 长电 K1	AAA	1.78

2.93Y(休 1)	281601.SH	26 冀交 05	AAA	2.05
2.93Y(休 1)	281601.SH	26 冀交 05	AAA	2.05
2.93Y	244598.SH	26 船舶 K1	AAA	1.79
2.94Y	244688.SH	26GTH06	AAA	1.8
2.94Y	244688.SH	26GTH06	AAA	1.8
2.94Y	244688.SH	26GTH06	AAA	1.8
2.94Y	244688.SH	26GTH06	AAA	1.8
2.94Y	244688.SH	26GTH06	AAA	1.8
2.94Y(休 10)	281450.SH	26 镇交 01	AA+	2.1
3Y(休 1)	524679.SZ	26 长江 01		1.88
3.01Y	244680.SH	26 银河 G4	AAA	1.8
3.37Y+NY	282480002.IB	24 泰康人寿永续债 01	AAA	2.09 行权
3.37Y+NY	282480002.IB	24 泰康人寿永续债 01	AAA	2.09 行权
3.37Y+NY	282480002.IB	24 泰康人寿永续债 01	AAA	2.09 行权
3.57Y+5Y	272400007.IB	24 中国人寿资本补充债 01BC	AAA	1.97 行权
3.57Y+5Y	272400007.IB	24 中国人寿资本补充债 01BC	AAA	1.97 行权
3.68Y	241883.SH	24 中化 15	AAA	1.87
3.73Y(休 1)	256446.SH	24 渝空 01	AA	2.4
3.73Y(休 1)	256446.SH	24 渝空 01	AA	2.4
3.73Y(休 1)	256446.SH	24 渝空 01	AA	2.4
3.78Y	256774.SH	24 渝空 02	AA	2.41
3.78Y	256774.SH	24 渝空 02	AA	2.41
4.16Y	242927.SH	25 国机 K1	AAA	1.88
4.28Y	243105.SH	25 船投 04	AAA	2.03
4.29Y	258948.SH	25 濮控 01	AA+	2.2
4.36Y(休 1)	134350.SZ	25 吉安 01	AA+	2.43
4.39Y	524378.SZ	25 穗开 K1	A+	2.02
4.49Y	2080227.IB	20 尧矿债 02	AAA	1.97
4.55Y	243817.SH	25 济城 G1	AAA	2.01
4.55Y	243817.SH	25 济城 G1	AAA	2.01
4.56Y(休 1)	280105.SH	25 建发 03	AA+	2.64
4.67Y+5Y(休 2)	244108.SH	25 湘江 01	A	1.99 行权
4.67Y+5Y(休 2)	244108.SH	25 湘江 01	A	1.99 行权
4.86Y(休 1)	244530.SH	26 南交 01	AAA	2.07
4.86Y(休 1)	244530.SH	26 南交 01	AAA	2.07
4.87Y	281294.SH	26 合投 K1	AAA	2.18
4.91Y	244631.SH	26 东证 C2	AAA	2.11
4.94Y+NY(休 1)	244719.SH	延长 KY26	AAA	2.07 行权
4.95Y	244727.SH	26 沪盛 01	AAA	1.935
4.95Y	244727.SH	26 沪盛 01	AAA	1.935

免责声明：本日评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、发表或引用日评内容。日评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评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。