



【2026-10-14】

国债

今日央行开展 560 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 0 亿，逆回购口径资金净投放 560 亿。

国债方面 1.37Y 250005 1.195-1.195； 3.28Y 250003 1.2925-1.2925； 5.45Y 250007 1.3925-1.395； 8.86Y 250016 1.61-1.6515； 28.86Y 2500006 2.109-2.1225。

|      | 1Y     | 3Y      | 5Y     | 7Y      | 10Y     | 30Y     |
|------|--------|---------|--------|---------|---------|---------|
| 昨日国债 | 1.03   | 1.21    | 1.365  | 1.4425  | 1.6225  | 2.12    |
| 今日国债 | 1.03   | 1.2     | 1.365  | 1.435   | 1.61    | 2.11    |
| 变动   | 0.0000 | -0.0100 | 0.0000 | -0.0075 | -0.0125 | -0.0100 |

金融债

金融债方面 97D 260401 1.33-1.34； 2.36Y 240203 1.41-1.42； 5.26Y 220205 1.51-1.513； 8.68Y 250215 1.67-1.69。

|          | 1Y      | 3Y      | 5Y      | 7Y      | 10Y     |
|----------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 昨日非国开金融债 | 1.403   | 1.45    | 1.45    | 1.6025  | 1.7     |
| 今日非国开金融债 | 1.405   | 1.445   | 1.445   | 1.6025  | 1.686   |
| 变动       | 0.0020  | -0.0050 | -0.0050 | 0.0000  | -0.0140 |
| 昨日国开债    | 1.3395  | 1.4225  | 1.468   | 1.5825  | 1.69    |
| 今日国开债    | 1.3375  | 1.4175  | 1.455   | 1.575   | 1.671   |
| 变动       | -0.0020 | -0.0050 | -0.0130 | -0.0075 | -0.0190 |

银行债

4-5y 大行二级交易较昨日更火爆，整体交易量活跃，配置盘较多，收益率全天震荡下行，全天交投频繁，期货收盘后收益率仍保持下行，全天资金很宽松，买盘情绪旺盛。4.9y 交易盘收益率上行至 1.755 最高，最低至 1.745，收 1.755，较上周更低，5y 农行 最低至 1.75，最终收 1.755 成交，4.9-5y 大行流动性，4.9y-5y 为最佳，工行主体流动性最强，4.85Y+5Y 26 工行二级资本债 05BC 全天最活跃，中介市场合计成交 101 笔，今日主要基金，理财买；基金，券商自营，大行卖。

4-5 股份制二永收益下行。4.64Y 26 兴业银行二级资本债 02 成交在 1.7475（-0.7）到 1.7525（-0.23），震荡区间 0.5bp。今日股份制二永不活跃。今日 1-3y 大行二级今日成交收益率盘内依然下行趋势，整体较昨日收盘下行近 0.50bp；1y 大行今开 1.465/1.46，最高成交在 1.46（-0.50）；尾盘收在 1.46/--。2y 附近大行今开 1.50/1.495，成交在 1.50（-0.09），尾盘收在 1.50/1.495。今日 1-3y 大行二级交易情绪较清淡，买盘力量较强于卖盘，基金、理财、银行、券商、保险均有参与。

商金方面，1-3y 大行主要成在估值（-2.20）到估值（+0.09）。1.7Y 25 邮储绿债 01BC(免) 成在 1.43 估值（+0.09）。股份制主要成在估值（-1.19）到估值（+0.02），2.79Y(银体 2) 26 广发银行债 01BC 成在 1.5575（-0.23）。大城商行主要成在估值（-1.52）到估值（-0.02），2.8Y 26 徽商银行 01 成在 1.565（-0.05）到 1.57（-0.05）。科创今日主要成在估值（-0.39）。1.6Y 25 徽商银行科创债 01(免) 成在 1.49 估值（-0.39）。银行、基金/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 2026Q4 和 2027Q1 期限。短端方面，15D 26 首钢 SCP001(科创债) AAA 成交在 1.44%（-0.06），基金出给银行；35D 25 广西林业 CP002 AA 成交在 1.815%（+0.16），银行出给券商。中长端方面，153D 26 湘高速 CP002 AAA 成交在 1.46%（-1.55），基金出给理财；166D 26 宜昌实业 SCP001 AAAsti 成交在 1.52%（-0.80），银行出给基金。长端方面，184D 26 电网 CP006 AAA 成交在 1.4425%（-0.05），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

中票收益上午在估值-0.5 附近，尾盘在估值-1 附近。汇金、电网今日成交情绪有所提高。2.79Y 汇金成交在 1.57%（-0.29）；9.54Y 电网成交在 1.915%（-0.82）。

1-3Y，好名字整体成交在估值-6 到估值+1，1.27Y 25 苏州高新 GN001 成在 1.55%（-0.96），1.6Y 25 苏交通 MTN003 成在 1.525%（-0.73），2.51Y 26 紫金矿业 MTN002(并购)成在 1.60%（-1.30）。成交收益率集中在 1.50%-2.00%，银行出给银行、理财。

3-5Y，好名字整体成交在估值-5 到估值+1，4.15Y 25 重庆机场 MTN003 成在 1.67%（-1.36），4.79Y 26 沪电气 MTN003(科创债/并购)成在 1.73%（-0.49），4.99Y 21 合建投 MTN002 成在 1.72%（-1.23）。收益率集中在 1.60%-2.00%，银行出给保险。

5Y+，7.29Y 24 葛洲坝 MTN001 成在 1.81%（-2.12）；7.95Y 24 中铝集 MTN007 成在 1.88%（-0.73），成交收益率主要集中在 1.75%-2.20%。永续中票成交集中在 3Y、5Y 左右的普通名字，收益率大概在估值-5 到估值+1，基金出给券商、基金。



企业债

交易所信用债全天交投活跃，基金，券商，保险，理财，银行均有参与，基金券商理财为主。全天收益率小幅震荡。

1 年内，券商债成交较为活跃，多成交在估值附近(311D(银休 2) 25GTHT07 1.49)，基金理财信托买，理财基金券商卖；非券商债多成交在 1.49-1.60（313D 24 光明 04 1.495），基金理财买，基金券商资管卖；年内科创债成交寥寥。

1-3 年，今日券商债成交一般，成交多在估值-1 附近（2.65Y(银休 1) 26GTHT09 1.57），基金券商资管理财买，基金券商银行卖；非券商债成交活跃，多成交在估值-1 附近（2.94Y(银休 2) 26 苏交 01 1.59），基金券商保险买，基金券商银行卖。科创债成交尚可，多成交在估值-1 附近(2.7Y 26 华电 K4 1.53)。

3-5 年，券商债今日成交寥寥；非券商债方面今日成交较活跃，成交多在估值-2.50 到估值+0.00（4.92Y 26 中化 02 1.715），基金券商双边参与，保险理财买，银行卖；科创方面今日成交尚可，成交在估值-1.5 到估值+0.5（4.83Y 26 京投 K1 1.63），基金券商双边参与，理财券商资管买，保险卖。

5Y+，券商债无成交，非券商债成交活跃，成交多在中证估值-2.5 附近，（12.43Y 24 深铁 07 2.38），基金券商资管买，银行基金卖，科创方面成交亦较活跃，成交多在中证估值-2 附近，（9.48Y 26 国新 K1 1.87）。



美元债

周三市场整体平稳。投资级方面，新发腾讯 10 年期美元债收窄 2-3bps(reoffer+90bps)。城投板块，买盘需求继续围绕在在 3-5%担保结构及性价比点心债，高收益券需求平平。地产板块整体变动在-0.25~0.25pt 区间

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        | 012600489.IB | 26 建发 SCP003      | AAA    | 1.65   |
| 15D       | 012680401.IB | 26 首钢 SCP001(科创债) | AAA    | 1.44   |
| 35D       | 042580606.IB | 25 广西林业 CP002     | AA     | 1.815  |
| 76D       | 012682388.IB | 26 伊利实业 SCP019    | AAA    | 1.42   |
| 153D      | 042680096.IB | 26 湘高速 CP002      | AAA    | 1.46   |
| 166D      | 012681638.IB | 26 宜昌实业 SCP001    | AAAsti | 1.52   |
| 184D      | 042680232.IB | 26 电网 CP006       | AAA    | 1.4425 |
| 184D      | 042680232.IB | 26 电网 CP006       | AAA    | 1.4425 |
| 221D(休 1) | 012682148.IB | 26 中交一航 SCP006    | AAA    | 1.44   |

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（%） |
|---------------|------------------------|----------------------|-----|--------|
| 2.79Y+2Y(休 2) | 102682789.IB           | 26 莫控 MTN005         | AAA | 1.67   |
| 2.79Y+2Y      | 102682848.IB           | 26 吉林高速 MTN005       | AAA | 1.66   |
| 2.82Y         | 102682978.IB           | 26 深圳高速 MTN003       | AAA | 1.595  |
| 2.83Y         | 102483498.IB           | 24 山东金融 MTN001       | AAA | 1.63   |
| 2.85Y(休 1)    | 102683155.IB           | 26 华为 MTN003         | AAA | 1.62   |
| 2.87Y+2Y      | 102683376.IB           | 26 宁德时代 MTN006A(科创债) | AAA | 1.635  |
| 2.87Y         | 102683418.IB           | 26 中建材集 MTN003(科创债)  | AAA | 1.6    |
| 2.96Y(休 9)    | 102683847.IB           | 26 越秀集团 MTN007       | AAA | 100    |
| 2.99Y+2Y      | 102683881.IB           | 26 吴中经发 MTN003       | AA+ | 1.64   |
| 2.99Y+2Y      | 102683881.IB           | 26 吴中经发 MTN003       | AA+ | 1.64   |
| 3Y(休 2)       | 102683900.IB           | 26 闽西兴杭 MTN004       | AAA | 1.7    |
| 3Y+NY(休 1)    | 102683954.IB(10.15 上市) | 26 粤交投 MTN009        | AAA | 100    |
| 3.7Y          | 102582645.IB           | 25 中兴通讯 MTN003(科创债)  | AAA | 1.74   |
| 3.75Y(休 1)    | 102582864.IB           | 25 自贡城投 MTN001       | AA+ | 1.85   |
| 3.81Y         | 102583246.IB           | 25 上虞水务 MTN002       | AA+ | 1.73   |
| 4.5Y          | 102681408.IB           | 26 乌经建 MTN001        | AA+ | 1.83   |
| 4.52Y(休 1)    | 102681500.IB           | 26 中煤能源 MTN001A      | AAA | 1.685  |
| 4.53Y         | 102681614.IB           | 26 香格里拉 MTN001B(BC)  | AAA | 1.945  |

|               |                        |                           |     |        |
|---------------|------------------------|---------------------------|-----|--------|
| 4.56Y+2Y      | 102681806.IB           | 26 湖州产投 MTN001            | AAA | 1.86   |
| 4.67Y         | 102682208.IB           | 26 苏国信 MTN014             | AAA | 1.67   |
| 4.7Y          | 102582624.IB           | 25 电网 MTN026              | AAA | 1.66   |
| 4.83Y         | 102683101.IB           | 26 国家能源 MTN004            | AAA | 100    |
| 4.85Y         | 102683381.IB           | 26 南电 MTN005              | AAA | 100    |
| 4.92Y         | 102683620.IB           | 26 晋能煤业 MTN017            | AAA | 1.84   |
| 4.93Y+NY      | 102683685.IB           | 26 济南轨交 MTN003            | AAA | 1.81   |
| 4.93Y         | 102683660.IB           | 26 广核电力 MTN007            | AAA | 1.675  |
| 4.94Y         | 102683735.IB           | 26 福州左海 MTN002            | AAA | 1.7225 |
| 4.94Y+NY      | 102683789.IB           | 26 潞安 MTN008              | AAA | 1.95   |
| 4.94Y+NY      | 102683789.IB           | 26 潞安 MTN008              | AAA | 1.95   |
| 5Y            | 102683976.IB(10.15 上市) | 26 商丘发展 MTN001            | AA+ | 100    |
| 5.27Y         | 132580005.IB           | 25 中燃气 GN001(两新)          | AAA | 2.04   |
| 6.31Y         | 102680433.IB           | 26 川发展 MTN002B            | AAA | 1.77   |
| 7.12Y         | 102584955.IB           | 25 电网 MTN039              | AAA | 1.77   |
| 7.29Y(休 1)    | 102480318.IB           | 24 葛洲坝 MTN001             | AAA | 1.81   |
| 7.72Y         | 102482881.IB           | 24 光大集团 MTN004B           | AAA | 1.825  |
| 7.76Y         | 102483072.IB           | 24 苏交通 MTN010             | AAA | 1.825  |
| 7.78Y+NY      | 102483200.IB           | 24 中冶 MTN005B             | AAA | 2.15   |
| 7.79Y         | 102483276.IB           | 24 中石化 MTN001             | AAA | 1.825  |
| 7.79Y         | 102483276.IB           | 24 中石化 MTN001             | AAA | 1.825  |
| 7.83Y+NY(休 1) | 102483477.IB           | 24 中冶 MTN007              | AAA | 2.15   |
| 7.95Y         | 102484255.IB           | 24 中铝集 MTN007             | AAA | 1.88   |
| 8.26Y         | 102580265.IB           | 25 中化股 MTN001             | AAA | 1.95   |
| 9.1Y          | 102584895.IB           | 25 中化股 MTN007             | AAA | 2.05   |
| 9.43Y         | 102681009.IB           | 26 国新控股 MTN001(稳增长扩投资专项债) | AAA | 1.92   |
| 9.43Y         | 102681009.IB           | 26 国新控股 MTN001(稳增长扩投资专项债) | AAA | 1.92   |
| 9.45Y         | 102681143.IB           | 26 电网 MTN008              | AAA | 1.9    |
| 9.45Y         | 102681143.IB           | 26 电网 MTN008              | AAA | 1.9075 |
| 9.62Y         | 102681947.IB           | 26 中远海能 MTN001(可持续挂钩)     | AAA | 2.01   |
| 9.62Y         | 102681947.IB           | 26 中远海能 MTN001(可持续挂钩)     | AAA | 2.01   |
| 9.62Y         | 102681947.IB           | 26 中远海能 MTN001(可持续挂钩)     | AAA | 2.01   |
| 9.62Y         | 102681947.IB           | 26 中远海能 MTN001(可持续挂钩)     | AAA | 2.01   |
| 9.62Y         | 102681947.IB           | 26 中远海能 MTN001(可持续挂钩)     | AAA | 2.01   |
| 9.62Y         | 102681947.IB           | 26 中远海能 MTN001(可持续挂钩)     | AAA | 2.01   |
| 9.62Y         | 102681947.IB           | 26 中远海能 MTN001(可持续挂钩)     | AAA | 2.01   |
| 9.62Y         | 102681963.IB           | 26 国新控股 MTN002(稳增长扩投资专项债) | AAA | 1.935  |
| 9.76Y         | 102682631.IB           | 26 国盛 MTN003(科创债)         | AAA | 1.9225 |
| 9.81Y         | 102682935.IB           | 26 皖交控 MTN007             | AAA | 1.925  |
| 9.81Y         | 102682935.IB           | 26 皖交控 MTN007             | AAA | 1.93   |
| 9.81Y         | 102682933.IB           | 26 蓉城轨交 MTN002            | AAA | 1.99   |
| 12.37Y(休 1)   | 102480540.IB           | 24 诚通控股 MTN006B           | AAA | 2.03   |
| 12.43Y(休 2)   | 102480955.IB           | 24 诚通控股 MTN009A           | AAA | 2.03   |
| 12.43Y(休 2)   | 102480955.IB           | 24 诚通控股 MTN009A           | AAA | 2.03   |
| 12.43Y(休 2)   | 102480955.IB           | 24 诚通控股 MTN009A           | AAA | 2.03   |
| 12.43Y(休 2)   | 102480955.IB           | 24 诚通控股 MTN009A           | AAA | 2.03   |
| 20D+2Y        | 102382978.IB           | 23 太原国投 MTN002            | AA+ | 1.64   |
| 20D+2Y        | 102382978.IB           | 23 太原国投 MTN002            | AA+ | 1.65   |

|               |              |                      |        |        |
|---------------|--------------|----------------------|--------|--------|
| 20D+2Y        | 102382978.IB | 23 太原国投 MTN002       | AA+    | 1.65   |
| 60D+NY(休 1)   | 102383273.IB | 23 陕延油 MTN004        | AAA    | 1.5    |
| 63D           | 102180077.IB | 21 靖江城投 MTN002       | AA/AAA | 1.48   |
| 145D          | 102480784.IB | 24 皖投集 MTN002A       | AAA    | 1.46   |
| 153D          | 102280524.IB | 22 首开 MTN003         | AAA    | 2.53   |
| 187D          | 102481628.IB | 24 恒逸 MTN001         | AA+    | 3.06   |
| 238D(休 1)     | 102281215.IB | 22 浏阳城乡 MTN003       | AAA    | 1.515  |
| 282D          | 102483146.IB | 24 中航租赁 MTN005       | AAA    | 1.54   |
| 327D          | 102282048.IB | 22 湖南临港 MTN001       | AA     | 1.6    |
| 341D          | 102400960.IB | 24 晋城国资 MTN003       | AA+    | 1.55   |
| 1.02Y(休 2)    | 102484560.IB | 24 京国资 MTN005        | AAA    | 1.49   |
| 1.03Y(休 1)    | 102484606.IB | 24 光大集团 MTN005       | AAA    | 1.475  |
| 1.04Y         | 102484643.IB | 24 杭海新城 MTN001       | AA+    | 1.53   |
| 1.1Y+NY(休 1)  | 102584896.IB | 25 鲁高速 MTN011        | AAA    | 1.54   |
| 1.16Y+NY(休 1) | 102485370.IB | 24 盐城资产 MTN005A      | AAA    | 1.55   |
| 1.18Y+NY(休 2) | 102485459.IB | 24 中交四航 MTN003       | AAA    | 1.57   |
| 1.37Y         | 102681883.IB | 26 三一 MTN003(科创债)    | AAA    | 1.53   |
| 1.37Y         | 102681883.IB | 26 三一 MTN003(科创债)    | AAA    | 1.53   |
| 1.37Y         | 102681883.IB | 26 三一 MTN003(科创债)    | AAA    | 1.53   |
| 1.43Y+NY      | 102581254.IB | 25 中节能 MTN001        | AAA    | 1.58   |
| 1.43Y         | 102581251.IB | 25 国航 MTN001         | AAA    | 1.52   |
| 1.51Y         | 102581705.IB | 25 光明 MTN001         | AAA    | 1.52   |
| 1.52Y         | 102300338.IB | 23 之江城投 MTN001       | AAA    | 1.55   |
| 1.52Y(休 1)    | 102581809.IB | 25 徐工集团 MTN003(科创票据) | AAA    | 1.54   |
| 1.58Y(休 1)    | 102582077.IB | 25 苏交通 MTN002        | AAA    | 1.52   |
| 1.6Y          | 102582089.IB | 25 浙能源 MTN002        | AAA    | 1.53   |
| 1.6Y          | 102582116.IB | 25 苏交通 MTN003        | AAA    | 1.525  |
| 1.61Y+NY      | 102582141.IB | 25 中冶 MTN008         | AAA    | 1.6    |
| 1.61Y+NY      | 102582141.IB | 25 中冶 MTN008         | AAA    | 1.6    |
| 1.62Y(休 3)    | 102681930.IB | 26 平安租赁 MTN012       | AAA    | 1.61   |
| 1.72Y+NY      | 102582730.IB | 25 晋焦煤 MTN001        | AAA    | 1.61   |
| 1.73Y(休 1)    | 102582775.IB | 25 赣粤 MTN001         | AAA    | 1.55   |
| 1.73Y(休 1)    | 102582775.IB | 25 赣粤 MTN001         | AAA    | 1.55   |
| 1.75Y         | 102582869.IB | 25 三峡新能 MTN003(科创债)  | AAA    | 1.545  |
| 1.75Y(休 2)    | 102582873.IB | 25 苏交通 MTN007        | AAA    | 1.545  |
| 1.76Y         | 102580354.IB | 25 电网 MTN002         | AAA    | 1.525  |
| 1.77Y(休 1)    | 102583012.IB | 25 苏国信 MTN006        | AAA    | 1.55   |
| 1.77Y(休 1)    | 102583012.IB | 25 苏国信 MTN006        | AAA    | 1.55   |
| 1.77Y(休 1)    | 102583012.IB | 25 苏国信 MTN006        | AAA    | 1.55   |
| 1.78Y         | 102583094.IB | 25 苏元禾 MTN002(科创债)   | AAA    | 1.58   |
| 1.78Y         | 102583094.IB | 25 苏元禾 MTN002(科创债)   | AAA    | 1.58   |
| 1.87Y+NY(休 1) | 102683374.IB | 26 冀中能源 MTN017A      | AAA    | 1.85   |
| 1.9Y          | 102382390.IB | 23 上实 MTN002B        | AAA    | 1.57   |
| 2.01Y+NY      | 102584277.IB | 25 鲁高速 MTN008        | AAA    | 1.58   |
| 2.07Y         | 102584675.IB | 25 苏交通 MTN010        | AAA    | 1.5725 |
| 2.07Y         | 102584675.IB | 25 苏交通 MTN010        | AAA    | 1.5725 |
| 2.07Y         | 102584675.IB | 25 苏交通 MTN010        | AAA    | 1.5725 |
| 2.07Y         | 102584678.IB | 25 广州地铁 MTN011       | AAA    | 1.56   |
| 2.31Y+2Y      | 102680458.IB | 26 紫金投资 MTN001(科创债)  | AAA    | 1.63   |
| 2.36Y(休 2)    | 102280352.IB | 22 福州城投 MTN002       | AAA    | 1.6    |
| 2.47Y         | 102481312.IB | 24 大横琴 MTN005        | AAA    | 1.7    |
| 2.56Y+2Y      | 102681785.IB | 26 紫金矿业 MTN003(并购)   | AAA    | 1.6    |
| 2.61Y         | 102584929.IB | 25 电网 MTN035         | AAA    | 1.565  |
| 2.61Y         | 102584929.IB | 25 电网 MTN035         | AAA    | 1.565  |

|            |              |                |     |       |
|------------|--------------|----------------|-----|-------|
| 2.61Y      | 102584929.IB | 25 电网 MTN035   | AAA | 1.565 |
| 2.71Y      | 102682385.IB | 26 北控集 MTN005  | AAA | 1.595 |
| 2.74Y      | 102482955.IB | 24 京能洁能 MTN001 | AAA | 1.61  |
| 2.75Y(休 1) | 102483018.IB | 24 中燃气 MTN003  | AAA | 1.77  |

今日企业债成交

| 剩余天数          | 债券代码       | 债券代码（发行机构）     | 评级         | 收益率（%） |
|---------------|------------|----------------|------------|--------|
| 5D            | 240064.SH  | 23 中证 24(免)    | AAA        | 1.42   |
| 8D            | 244004.SH  | 25 中证 S8       | AAA/A-1    | 1.46   |
| 11D(休 1)      | 241784.SH  | 24 安租 09       | AAA        | 1.65   |
| 12D           | 240099.SH  | 23 中财 C3(免)    | AAA        | 1.42   |
| 22D           | 244049.SH  | 25 中证 10       | AAA        | 1.46   |
| 33D           | 148510.SZ  | 23 长城 10(免)    | AAA        | 1.4    |
| 93D           | 253475.SH  | 24 崂南 01       | AA/AA+     | 1.53   |
| 110D          | 253706.SH  | 24 自高 01       | AA         | 1.83   |
| 110D          | 253706.SH  | 24 自高 01       | AA         | 1.83   |
| 138D+NY       | 240611.SH  | 建工 KY09        | AAA/AAAsti | 1.535  |
| 163D          | 254276.SH  | 24 渭控 01       | AA+        | 1.63   |
| 187D+2Y       | 184354.SH  | 22 平湖债         | AA+/AAA    | 1.35   |
| 218D          | 241013.SH  | 24CHNG3K       | AAA/AAAsti | 1.44   |
| 231D+NY       | 185858.SH  | 国新 YK01        | AAA/AAAsti | 1.46   |
| 248D(休 2)     | 148780.SZ  | 24 长城 03(免)    | AAA        | 1.46   |
| 249D(休 1)     | 241142.SH  | 24 光证 G2(免)    | AAA        | 1.445  |
| 249D(休 1)     | 241142.SH  | 24 光证 G2(免)    | AAA        | 1.445  |
| 252D+NY       | 243216.SH  | 尧矿` KY04       | AAA/AAAsti | 1.53   |
| 253D+NY       | 185911.SH  | 22 信投 Y2(免)    | AAA        | 1.47   |
| 258D          | 245562.SH  | 26 中证 S4       | AAA/A-1    | 1.48   |
| 282D          | 243362.SH  | 25 国保 02       | AAA        | 1.52   |
| 284D+2Y(休 1)  | 255427.SH  | 24 迈瑞 01       | AA+        | 1.62   |
| 286D+NY       | 148005.SZ  | 22 申证 Y1(免)    | AAA        | 1.48   |
| 305D(休 1)     | 2422047.IB | 24 奔驰汽车债 03(免) | AAA        | 1.47   |
| 305D(休 1)     | 2422047.IB | 24 奔驰汽车债 03(免) | AAA        | 1.47   |
| 306D          | 2422048.IB | 24 汇理汽车债 02(免) | AAA        | 1.47   |
| 310D          | 255480.SH  | 24 哈密 03       | AA         | 1.61   |
| 311D(休 2)     | 243544.SH  | 25GTHT07       | AAA        | 1.49   |
| 333D(休 1)     | 243776.SH  | 25 平证 27       | AAA        | 1.49   |
| 339D(休 2)     | 241643.SH  | 24 交租 01       | AAA        | 1.54   |
| 340D(休 1)     | 241635.SH  | 24 三资 01       | AAA        | 1.49   |
| 1.02Y         | 243970.SH  | 25 中证 G8       | AAA        | 1.49   |
| 1.11Y+2Y      | 256548.SH  | 24 柳控 06       | AA+        | 1.8    |
| 1.16Y(休 1)    | 244286.SH  | 25 光证 G7       | AAA        | 1.5    |
| 1.4Y          | 250153.SH  | 23 台城 01       | AAA        | 1.54   |
| 1.58Y(休 2)    | 242589.SH  | 25 银河 K1(免)    | AAA/AAAsti | 1.48   |
| 1.61Y+NY      | 148298.SZ  | 23 光大 Y6       | AAA        | 1.47   |
| 1.62Y+NY(休 2) | 243050.SH  | 25 华新 Y1       | AAA        | 1.59   |
| 1.62Y+NY(休 2) | 243050.SH  | 25 华新 Y1       | AAA        | 1.59   |
| 1.66Y+2Y(休 1) | 524300.SZ  | 25 珠华 01       | AAA        | 2.7    |
| 1.71Y(休 2)    | 243238.SH  | 25 电投 K5       | AAA        | 1.5    |
| 1.83Y+NY      | 243547.SH  | 25 中公 Y8       | AAA        | 1.63   |
| 1.85Y+NY      | 243496.SH  | 首钢 YK01        | AAA/AAAsti | 1.6    |
| 1.87Y+NY      | 243665.SH  | 25 华新 Y3       | AAA        | 1.6    |
| 1.87Y+NY      | 243665.SH  | 25 华新 Y3       | AAA        | 1.6    |
| 1.94Y+NY      | 246115.SH  | 26 港口 Y3       | AAA        | 1.63   |
| 2.01Y         | 184090.SH  | 21 景陶债         | AA+        | 1.68   |
| 2.04Y         | 240085.SH  | 23 山能 K2       | AAA/AAAsti | 1.53   |

|               |              |               |            |       |
|---------------|--------------|---------------|------------|-------|
| 2.04Y         | 240085.SH    | 23 山能 K2      | AAA/AAAsti | 1.53  |
| 2.08Y         | 280714.SH    | 25 共享 02      | AA         | 1.9   |
| 2.16Y+NY      | 240397.SH    | 铁工 YK22       | AAA        | 1.58  |
| 2.29Y(休 1)    | 244564.SH    | 26 海陵 G2      | AA+        | 1.65  |
| 2.43Y         | 254194.SH    | 24 株金 01      | AA/AA+     | 1.95  |
| 2.49Y         | 2380104.IB   | 23 科学城 01     | AA+/AAA    | 1.7   |
| 2.52Y         | 254621.SH    | 24SHLG02      | AAA        | 1.66  |
| 2.54Y(休 4)    | 254691.SH    | 24 武空 02      | AA+        | 1.68  |
| 2.62Y+NY      | 244789.SH    | 26 三峡 Y1      | AAA        | 1.71  |
| 2.65Y         | 282798.SH    | 26 南湖 01      | AA         | 1.78  |
| 2.75Y         | 241297.SH    | 24 渝东 01      | AA+        | 1.75  |
| 2.77Y(休 1)    | 245529.SH    | 26 杭实 K1      | AAA        | 1.57  |
| 2.78Y         | 252680007.IB | 26 华夏金租债 03   | AAA        | 1.613 |
| 2.78Y         | 252680007.IB | 26 华夏金租债 03   | AAA        | 1.613 |
| 2.88Y(休 2)    | 245734.SH    | 26 盛泽 G1      | AA         | 1.7   |
| 2.92Y         | 283691.SH    | 26 嘉科 01      | AA+        | 1.71  |
| 2.92Y(休 2)    | 283845.SH    | 26 余创 01      | AAA        | 1.72  |
| 2.93Y         | 283946.SH    | 26 津国 03      | AAA        | 1.81  |
| 2.93Y         | 283946.SH    | 26 津国 03      | AAA        | 1.81  |
| 2.93Y         | 283946.SH    | 26 津国 03      | AAA        | 1.81  |
| 2.94Y         | 520494.SZ    | 26 南交 03      | AAA        | 1.68  |
| 2.94Y+2Y(休 2) | 284093.SH    | 26 金霞 02      | AA+        | 1.69  |
| 2.95Y(休 1)    | 284022.SH    | 26 黄经 02      | AA+        | 1.71  |
| 2.95Y(休 1)    | 284022.SH    | 26 黄经 02      | AA+        | 1.71  |
| 3.17Y(休 1)    | 256715.SH    | 24 宣教 02      | AA         | 1.82  |
| 3.17Y(休 1)    | 256715.SH    | 24 宣教 02      | AA         | 1.82  |
| 3.22Y         | 242228.SH    | 25 首集 K1      | AAA        | 1.74  |
| 3.26Y         | 111088.SZ    | 20 华发债        | AAA        | 3.15  |
| 3.5Y+5Y(休 1)  | 134200.SZ    | 25 嘉城 02      | AAA        | 1.71  |
| 3.5Y+5Y(休 1)  | 134200.SZ    | 25 嘉城 02      | AAA        | 1.71  |
| 3.95Y         | 280212.SH    | 25 皋通 01      | AA+        | 1.8   |
| 3.95Y         | 280212.SH    | 25 皋通 01      | AA+        | 1.8   |
| 4.21Y+NY(休 1) | 281168.SH    | 25 蓉高 Y2      | AAA        | 1.83  |
| 4.21Y+NY(休 1) | 281168.SH    | 25 蓉高 Y2      | AAA        | 1.83  |
| 4.31Y         | 281662.SH    | 26 临平 01      | AAA        | 1.74  |
| 4.32Y(休 1)    | 281588.SH    | 26 兰产 01      | AA+        | 1.86  |
| 4.39Y+NY      | 524687.SZ    | 26 国证 Y2      | AAA        | 1.785 |
| 4.4Y          | 134884.SZ    | 26 杭高 02      | AAA        | 1.76  |
| 4.48Y         | 282282.SH    | 26 冀交 07      | AAA        | 1.8   |
| 4.49Y         | 282330.SH    | 26 固镇 02      | AA         | 1.92  |
| 4.5Y          | 282380.SH    | 26 冀交 09      | AAA        | 1.8   |
| 4.61Y+NY(休 1) | 245227.SH    | 26GTHTY3      | AAA        | 1.78  |
| 4.64Y+NY      | 245316.SH    | 26GTHTY5      | AAA        | 1.78  |
| 4.64Y+NY      | 245316.SH    | 26GTHTY5      | AAA        | 1.78  |
| 4.65Y+2Y      | 245340.SH    | 26 广城 04      | AAA        | 1.87  |
| 4.65Y+2Y      | 245340.SH    | 26 广城 04      | AAA        | 1.87  |
| 4.74Y         | 283245.SH    | 26 天宁 03      | AA+        | 1.82  |
| 4.77Y+NY      | 282680009.IB | 26 新华人寿永续债 01 | AAA        | 1.79  |
| 4.79Y         | 283503.SH    | 26 两江 07      | AAA        | 1.81  |
| 4.82Y         | 245826.SH    | 26 杭交 03      | AAA        | 1.68  |
| 4.83Y         | 245859.SH    | 26 京投 K1      | AAA/AAAsti | 1.63  |
| 4.86Y(休 1)    | 245873.SH    | 26 环保 K4      | AAA        | 1.67  |
| 4.88Y         | 283831.SH    | 26 淮联 07      | AAA        | 1.81  |
| 4.89Y         | 283848.SH    | 26 金国 03      | AAA        | 1.8   |
| 4.9Y(休 1)     | 246001.SH    | 26 京投 K3      | AAA/AAAsti | 1.63  |

|                |              |                   |            |        |
|----------------|--------------|-------------------|------------|--------|
| 4.92Y(休 1)     | 246038.SH    | 26 中化 02          | AAA        | 1.715  |
| 4.92Y(休 1)     | 246076.SH    | 26 延长 K8          | AAA        | 1.655  |
| 4.92Y(休 1)     | 246038.SH    | 26 中化 02          | AAA        | 1.715  |
| 4.92Y(休 1)     | 246038.SH    | 26 中化 02          | AAA        | 1.7175 |
| 4.94Y+2Y       | 246100.SH    | 26 广城 08          | AAA        | 1.88   |
| 4.94Y+2Y       | 246100.SH    | 26 广城 08          | AAA        | 1.88   |
| 4.94Y+5Y       | 272680010.IB | 26 人保再保资本补充债 01   | AAA        | 1.8    |
| 4.94Y          | 246151.SH    | 26 财信 03          | AAA        | 1.72   |
| 4.94Y          | 246151.SH    | 26 财信 03          | AAA        | 1.72   |
| 4.94Y          | 246151.SH    | 26 财信 03          | AAA        | 1.72   |
| 4.94Y          | 246151.SH    | 26 财信 03          | AAA        | 1.72   |
| 4.94Y          | 246151.SH    | 26 财信 03          | AAA        | 1.72   |
| 4.95Y          | 520500.SZ    | 26 诸建 02          | AA+        | 1.88   |
| 5.07Y(休 1)     | 1180156.IB   | 11 铁道 06          | AAA        | 1.595  |
| 6.83Y(休 1)     | 1380252.IB   | 13 铁道 03          | AAA        | 1.6875 |
| 7Y(休 2)        | 1380305.IB   | 13 铁道 08          | AAA        | 1.6925 |
| 9.48Y          | 244976.SH    | 26 国新 K1          | AAA/AAAsti | 1.87   |
| 9.52Y          | 245114.SH    | 26 国投 G1          | AAA        | 1.9    |
| 9.73Y(休 1)     | 245591.SH    | 26 两江 06          | AAA        | 2.09   |
| 9.79Y          | 245778.SH    | 26 太新 G1          | AAA        | 2.215  |
| 9.79Y          | 245778.SH    | 26 太新 G1          | AAA        | 2.215  |
| 9.85Y          | 245949.SH    | 26 国能 K3          | AAA        | 1.89   |
| 9.86Y(休 1)     | 245924.SH    | 26 太新 G2          | AAA        | 2.21   |
| 12.41Y         | 148641.SZ    | 24 深铁 06          | AAA        | 2.38   |
| 12.43Y         | 148664.SZ    | 24 深铁 07          | AAA        | 2.38   |
| 12.9Y          | 148899.SZ    | 24 深投 06          | AAA        | 2.03   |
| 12.9Y          | 148899.SZ    | 24 深投 06          | AAA        | 2.03   |
| 14.64Y         | 245372.SH    | 26 诚通 08          | AAA        | 2.095  |
| 14.78Y         | 245727.SH    | 26 铝集 K3          | AAA        | 2.08   |
| 14.81Y         | 245809.SH    | 26 诚通 12          | AAA        | 2.08   |
| 14.81Y         | 245809.SH    | 26 诚通 12          | AAA        | 2.08   |
| 19.8Y+NY       | 245744.SH    | 华能 YK31           | AAA/AAAsti | 2.31   |
| 19.93Y         | 246128.SH    | 26 电投 K7          | AAA        | 2.15   |
| 19.94Y(休 1)    | 246138.SH    | 26 皖能 02          | AAA        | 2.22   |
| 19.94Y+NY(休 1) | 246134.SH    | 华能 YK33           | AAA/AAAsti | 2.31   |
| 19.94Y(休 1)    | 246138.SH    | 26 皖能 02          | AAA        | 2.23   |
| 30Y            | 2680036.IB   | 26 铁道 18          | AAA        | 2.21   |
| 36D            | 032481533.IB | 24 海安开投 PPN005    | AA+        | 1.53   |
| 152D+2Y        | 032480260.IB | 24 鲁中投资 PPN002    | AA         | 2.25   |
| 1.95Y          | 032380941.IB | 23 宜春城投 PPN002    | AA         | 1.68   |
| 2.92Y+2Y(休 1)  | 032680526.IB | 26 望城城投 PPN001    | AA+        | 1.65   |
| 2.92Y+2Y(休 1)  | 032680526.IB | 26 望城城投 PPN001    | AA+        | 1.65   |
| 3.99Y          | 032680549.IB | 26 南通城建 PPN002    | AAA        | 1.74   |
| 4.62Y          | 032680302.IB | 26 摩根士丹利 PPN002BC | AAA        | 1.925  |
| 4.62Y          | 032680302.IB | 26 摩根士丹利 PPN002BC | AAA        | 1.925  |

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（%） |
|--------|--------------|-----------------|-----|--------|
| 13D    | 212380022.IB | 23 华夏银行债 04(免)  | AAA | 1.35   |
| 26D+5Y | 2128033.IB   | 21 建设银行二级 03(免) | AAA | 1.405  |
| 26D+5Y | 2128033.IB   | 21 建设银行二级 03(免) | AAA | 1.405  |
| 26D    | 212380023.IB | 23 光大银行债 03(免)  | AAA | 1.36   |
| 28D+5Y | 2128036.IB   | 21 平安银行二级(免)    | AAA | 1.405  |
| 28D+5Y | 2128036.IB   | 21 平安银行二级(免)    | AAA | 1.405  |
| 28D+5Y | 2128036.IB   | 21 平安银行二级(免)    | AAA | 1.405  |

|               |              |                            |            |        |
|---------------|--------------|----------------------------|------------|--------|
| 28D+5Y        | 2128036.IB   | 21 平安银行 二级(免)              | AAA        | 1.405  |
| 28D+5Y        | 2128036.IB   | 21 平安银行 二级(免)              | AAA        | 1.405  |
| 41D           | 2321034.IB   | 23 长沙农商 01(免)              | AA+        | 1.4    |
| 42D+5Y        | 2128042.IB   | 21 兴业银行 二级 02(免)           | AAA        | 1.42   |
| 62D+5Y        | 2128051.IB   | 21 工商银行 二级 02(免)           | AAA        | 1.42   |
| 317D          | 2420038.IB   | 24 汉口银行 小微债(免)             | AAA        | 1.48   |
| 321D+NY       | 092280083.IB | 22 建行永续债 01(免)             | AAA        | 1.46   |
| 321D+NY       | 092280083.IB | 22 建行永续债 01(免)             | AAA        | 1.46   |
| 321D+NY       | 092280083.IB | 22 建行永续债 01(免)             | AAA        | 1.46   |
| 348D          | 212480059.IB | 24 稠州商行 小微债 01(免)          | AA+        | 1.53   |
| 348D          | 212480059.IB | 24 稠州商行 小微债 01(免)          | AA+        | 1.53   |
| 1.03Y+5Y      | 092280108.IB | 22 中行 二级资本债 02A(免)         | AAA        | 1.46   |
| 1.03Y+5Y      | 092280108.IB | 22 中行 二级资本债 02A(免)         | AAA        | 1.46   |
| 1.07Y(休 1)    | 212400013.IB | 24 中信银行 债 02BC(免)          | AAA        | 1.45   |
| 1.07Y(休 1)    | 212400013.IB | 24 中信银行 债 02BC(免)          | AAA        | 1.45   |
| 1.07Y+5Y(休 1) | 092280131.IB | 22 建行 二级资本债 02A(免)         | AAA        | 1.46   |
| 1.07Y+5Y      | 092280134.IB | 22 工行 二级资本债 04A(免)         | AAA        | 1.465  |
| 1.09Y+5Y      | 092280139.IB | 22 交行 二级资本债 02A(免)         | AAA        | 1.4625 |
| 1.18Y+NY      | 242280004.IB | 22 重庆银行 永续债 01(免)          | AAA        | 1.52   |
| 1.54Y         | 2528007.IB   | 25 浦发银行 01(免)              | AAA        | 1.47   |
| 1.54Y         | 2528007.IB   | 25 浦发银行 01(免)              | AAA        | 1.47   |
| 1.54Y         | 2528008.IB   | 25 浦发银行 02(免)              | AAA        | 1.47   |
| 1.6Y(休 1)     | 332580005.IB | 25 浙商银行 科创债 01BC(免)        | AAA/AAAsti | 1.493  |
| 1.64Y(休 2)    | 2520016.IB   | 25 徽商银行 01(免)              | AAA        | 1.495  |
| 1.67Y+1Y      | 312510001.IB | 25 交行 TLAC 非资本债 01A(BC)(免) | AAA        | 1.49   |
| 1.7Y          | 222580007.IB | 25 邮储绿债 01BC(免)            | AAA        | 1.43   |
| 1.7Y          | 222580007.IB | 25 邮储绿债 01BC(免)            | AAA        | 1.43   |
| 1.81Y+1Y(休 2) | 312510009.IB | 25 农行 TLAC 非资本债 02A(BC)(免) | AAA        | 1.495  |
| 1.85Y+1Y(休 2) | 312510012.IB | 25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)     | AAA        | 1.55   |
| 1.85Y+1Y(休 2) | 312510012.IB | 25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)     | AAA        | 1.55   |
| 1.92Y+5Y      | 232380052.IB | 23 农行 二级资本债 02A(免)         | AAA        | 1.5    |
| 1.92Y+5Y      | 232380052.IB | 23 农行 二级资本债 02A(免)         | AAA        | 1.5    |
| 2.02Y+5Y      | 232380066.IB | 23 中行 二级资本债 03A(免)         | AAA        | 1.5025 |
| 2.02Y+5Y      | 232380066.IB | 23 中行 二级资本债 03A(免)         | AAA        | 1.5025 |
| 2.03Y+5Y      | 232380069.IB | 23 建行 二级资本债 02A(免)         | AAA        | 1.505  |
| 2.05Y+5Y      | 232380073.IB | 23 农行 二级资本债 03A(免)         | AAA        | 1.505  |
| 2.05Y+5Y      | 232380073.IB | 23 农行 二级资本债 03A(免)         | AAA        | 1.505  |
| 2.09Y+5Y      | 232380076.IB | 23 建行 二级资本债 03A(免)         | AAA        | 1.5075 |
| 2.09Y+5Y      | 232380076.IB | 23 建行 二级资本债 03A(免)         | AAA        | 1.505  |
| 2.09Y+5Y      | 232380076.IB | 23 建行 二级资本债 03A(免)         | AAA        | 1.505  |
| 2.09Y+5Y      | 232380076.IB | 23 建行 二级资本债 03A(免)         | AAA        | 1.505  |
| 2.09Y+5Y      | 232380076.IB | 23 建行 二级资本债 03A(免)         | AAA        | 1.505  |
| 2.09Y+5Y      | 232380076.IB | 23 建行 二级资本债 03A(免)         | AAA        | 1.505  |
| 2.09Y+5Y      | 232380078.IB | 23 交行 二级资本债 01A(免)         | AAA        | 1.505  |
| 2.09Y+5Y      | 232380078.IB | 23 交行 二级资本债 01A(免)         | AAA        | 1.505  |
| 2.09Y+NY      | 242380026.IB | 23 杭州联合农商 永续债 01(免)        | AAA/AA+    | 1.55   |
| 2.13Y+1Y      | 312510016.IB | 25 农行 TLAC 非资本债 03A(BC)    | AAA        | 1.565  |
| 2.14Y+5Y      | 232380084.IB | 23 中行 二级资本债 04A(免)         | AAA        | 1.51   |
| 2.14Y+5Y      | 232380084.IB | 23 中行 二级资本债 04A(免)         | AAA        | 1.51   |
| 2.14Y+5Y      | 232380084.IB | 23 中行 二级资本债 04A(免)         | AAA        | 1.51   |
| 2.14Y+5Y      | 232380084.IB | 23 中行 二级资本债 04A(免)         | AAA        | 1.51   |
| 2.16Y+NY      | 242380035.IB | 23 齐商银行 永续债 01(免)          | AA+/AA     | 2.24   |

|               |              |                         |        |        |
|---------------|--------------|-------------------------|--------|--------|
| 2.31Y+5Y      | 232480006.IB | 24 建行二级资本债 01A(免)       | AAA    | 1.52   |
| 2.31Y+5Y      | 232480006.IB | 24 建行二级资本债 01A(免)       | AAA    | 1.52   |
| 2.48Y+5Y(休 1) | 232480008.IB | 24 中行二级资本债 02A(免)       | AAA    | 1.5325 |
| 2.51Y+5Y      | 232480010.IB | 24 浙商银行二级资本债 01(免)      | AAA    | 1.56   |
| 2.53Y+5Y      | 232480011.IB | 24 农行二级资本债 02A(免)       | AAA    | 1.535  |
| 2.53Y+NY      | 242400007.IB | 24 中信银行永续债 01(免)        | AAA    | 1.565  |
| 2.54Y+1Y(休 4) | 312610004.IB | 26 工行 TLAC 非资本债 01BC    | AAA    | 1.5875 |
| 2.54Y+1Y(休 4) | 312610004.IB | 26 工行 TLAC 非资本债 01BC    | AAA    | 1.5875 |
| 2.54Y+5Y(休 4) | 232480014.IB | 24 交行二级资本债 01A(免)       | AAA    | 1.5375 |
| 2.58Y+1Y      | 312610005.IB | 26 交行 TLAC 非资本债 01BC    | AAAspc | 1.5875 |
| 2.6Y+1Y       | 312610009.IB | 26 中行 TLAC 非资本债 01BC    | AAA    | 1.59   |
| 2.6Y+1Y       | 312610009.IB | 26 中行 TLAC 非资本债 01BC    | AAA    | 1.59   |
| 2.62Y         | 292680016.IB | 26 中银香港债 01BC           | AAA    | 1.6275 |
| 2.64Y+NY      | 242400009.IB | 24 农行永续债 02(免)          | AAA    | 1.565  |
| 2.66Y+NY      | 242480004.IB | 24 华夏银行永续债 01(免)        | AAA    | 1.595  |
| 2.68Y+NY      | 242480005.IB | 24 杭州银行永续债 01(免)        | AAA    | 1.595  |
| 2.73Y+5Y(休 1) | 232480033.IB | 24 建行二级资本债 02A(免)       | AAA    | 1.5575 |
| 2.73Y+5Y(休 1) | 232480033.IB | 24 建行二级资本债 02A(免)       | AAA    | 1.5575 |
| 2.73Y+5Y(休 1) | 232480033.IB | 24 建行二级资本债 02A(免)       | AAA    | 1.5575 |
| 2.74Y+5Y      | 232480032.IB | 24 兴业银行二级资本债 02(免)      | AAA    | 1.565  |
| 2.74Y+NY      | 242480007.IB | 24 工行永续债 01(免)          | AAA    | 1.57   |
| 2.76Y         | 212680001.IB | 26 江苏银行债 01BC           | AAA    | 1.565  |
| 2.77Y         | 212680003.IB | 26 上海银行债 01             | AAA    | 1.5625 |
| 2.77Y         | 212680003.IB | 26 上海银行债 01             | AAA    | 1.5625 |
| 2.79Y(休 2)    | 212680006.IB | 26 广发银行债 01BC           | AAA    | 1.5575 |
| 2.79Y(休 2)    | 212680006.IB | 26 广发银行债 01BC           | AAA    | 1.5575 |
| 2.79Y(休 2)    | 212680006.IB | 26 广发银行债 01BC           | AAA    | 1.5575 |
| 2.79Y(休 2)    | 212680006.IB | 26 广发银行债 01BC           | AAA    | 1.5575 |
| 2.79Y(休 2)    | 212680006.IB | 26 广发银行债 01BC           | AAA    | 1.5575 |
| 2.8Y          | 2620001.IB   | 26 徽商银行 01              | AAA    | 1.566  |
| 2.8Y          | 2620001.IB   | 26 徽商银行 01              | AAA    | 1.57   |
| 2.82Y         | 222680012.IB | 26 中信银行绿债 01BC          | AAA    | 1.535  |
| 2.85Y         | 212680024.IB | 26 珠海农商行债 01            | AA+    | 1.645  |
| 2.85Y         | 212680024.IB | 26 珠海农商行债 01            | AA+    | 1.645  |
| 2.85Y         | 212680022.IB | 26 恒丰银行债 01             | AAA    | 1.575  |
| 2.85Y         | 222680013.IB | 26 兴业银行绿债 01A           | AAA    | 1.54   |
| 2.86Y         | 212680025.IB | 26 青岛农商行小微债 01          | AAA    | 1.58   |
| 2.86Y+1Y      | 312610012.IB | 26 建行 TLAC 非资本债 02A(BC) | AAA    | 1.6025 |
| 2.86Y+1Y      | 312610012.IB | 26 建行 TLAC 非资本债 02A(BC) | AAA    | 1.6025 |
| 2.86Y(休 2)    | 212680021.IB | 26 顺德农商行债 02            | AAA    | 1.58   |
| 2.86Y(休 2)    | 212680021.IB | 26 顺德农商行债 02            | AAA    | 1.58   |
| 2.86Y(休 2)    | 212680021.IB | 26 顺德农商行债 02            | AAA    | 1.58   |
| 2.9Y          | 212680034.IB | 26 江苏银行债 03BC           | AAA    | 1.5675 |
| 2.9Y          | 212680034.IB | 26 江苏银行债 03BC           | AAA    | 1.5675 |
| 2.9Y          | 212680034.IB | 26 江苏银行债 03BC           | AAA    | 1.5675 |
| 2.9Y          | 212680034.IB | 26 江苏银行债 03BC           | AAA    | 1.5675 |
| 2.9Y+1Y       | 312610014.IB | 26 中行 TLAC 非资本债 02A(BC) | AAA    | 1.6025 |
| 2.9Y+1Y       | 312610014.IB | 26 中行 TLAC 非资本债 02A(BC) | AAA    | 1.6025 |
| 2.92Y         | 212680042.IB | 26 平安银行债 01             | AAA    | 1.5625 |
| 2.92Y(休 2)    | 212680041.IB | 26 贵州银行小微债 01           | AAA    | 1.65   |
| 2.93Y         | 212680043.IB | 26 浦发银行债 01             | AAA    | 1.5525 |
| 2.93Y         | 212680043.IB | 26 浦发银行债 01             | AAA    | 1.5525 |

|               |              |                         |         |        |
|---------------|--------------|-------------------------|---------|--------|
| 2.93Y         | 212680044.IB | 26 民生银行债 01             | AAA     | 1.5675 |
| 2.93Y         | 2620008.IB   | 26 青岛银行 01              | AAA     | 1.58   |
| 2.93Y         | 212680051.IB | 26 徽商银行债 02             | AAA     | 1.57   |
| 2.93Y         | 212680043.IB | 26 浦发银行债 01             | AAA     | 1.5525 |
| 2.93Y         | 212680044.IB | 26 民生银行债 01             | AAA     | 1.5675 |
| 2.93Y         | 212680051.IB | 26 徽商银行债 02             | AAA     | 1.57   |
| 2.93Y         | 212680051.IB | 26 徽商银行债 02             | AAA     | 1.57   |
| 2.93Y         | 212680051.IB | 26 徽商银行债 02             | AAA     | 1.57   |
| 2.93Y         | 212680051.IB | 26 徽商银行债 02             | AAA     | 1.57   |
| 2.93Y         | 212680043.IB | 26 浦发银行债 01             | AAA     | 1.5525 |
| 2.95Y+NY      | 232480067.IB | 24 华夏银行永续债 02(免)        | AAA     | 1.6175 |
| 2.96Y         | 222680026.IB | 26 湖南银行绿债 01            | AAA     | 1.5825 |
| 2.96Y         | 212680058.IB | 26 重庆银行债 01             | AAA     | 1.58   |
| 2.96Y         | 2621007.IB   | 26 青岛农商 02              | AAA     | 1.585  |
| 2.96Y         | 2621007.IB   | 26 青岛农商 02              | AAA     | 1.585  |
| 3Y+1Y         | 312610016.IB | 26 农行 TLAC 非资本债 03A(BC) | AAA     | 1.615  |
| 3.04Y+5Y(休 1) | 232480073.IB | 24 工行二级资本债 02BC(免)      | AAA     | 1.5775 |
| 3.36Y+NY      | 242580002.IB | 25 邮储永续债 01BC(免)        | AAA     | 1.6125 |
| 3.36Y+NY      | 242580002.IB | 25 邮储永续债 01BC(免)        | AAA     | 1.6125 |
| 3.54Y+5Y      | 232580008.IB | 25 工行二级资本债 02BC(免)      | AAA     | 1.615  |
| 3.54Y+5Y      | 232580008.IB | 25 工行二级资本债 02BC(免)      | AAA     | 1.615  |
| 3.58Y+NY      | 242580011.IB | 25 工行永续债 01BC(免)        | AAA     | 1.625  |
| 3.58Y+NY      | 242580011.IB | 25 工行永续债 01BC(免)        | AAA     | 1.625  |
| 3.59Y+NY(休 1) | 242580012.IB | 25 建行永续债 01BC(免)        | AAA     | 1.625  |
| 3.59Y+5Y(休 1) | 232580009.IB | 25 中信银行二级资本债 01BC(免)    | AAA     | 1.615  |
| 3.59Y+5Y(休 1) | 232580009.IB | 25 中信银行二级资本债 01BC(免)    | AAA     | 1.62   |
| 3.59Y+5Y(休 1) | 232580009.IB | 25 中信银行二级资本债 01BC(免)    | AAA     | 1.615  |
| 3.61Y+5Y(休 1) | 232580012.IB | 25 中行二级资本债 01BC(免)      | AAA     | 1.6175 |
| 3.61Y+5Y(休 1) | 232580012.IB | 25 中行二级资本债 01BC(免)      | AAA     | 1.6175 |
| 3.61Y+5Y(休 1) | 232580011.IB | 25 北部湾银行二级资本债 01(免)     | AAA/AA+ | 1.8    |
| 3.61Y+5Y(休 1) | 232580012.IB | 25 中行二级资本债 01BC(免)      | AAA     | 1.62   |
| 3.61Y+5Y(休 1) | 232580012.IB | 25 中行二级资本债 01BC(免)      | AAA     | 1.62   |
| 3.62Y+NY      | 242580017.IB | 25 农行永续债 01BC(免)        | AAA     | 1.63   |
| 3.66Y+NY      | 242580019.IB | 25 浦发银行永续债 01(免)        | AAA     | 1.655  |
| 3.8Y+5Y(休 2)  | 2028026.IB   | 20 浦发银行二级 02(免)         | AAA     | 1.635  |
| 3.8Y+5Y(休 2)  | 2028026.IB   | 20 浦发银行二级 02(免)         | AAA     | 1.63   |
| 3.87Y+NY      | 242580035.IB | 25 中行永续债 02BC           | AAA     | 1.695  |
| 3.87Y+NY      | 242580035.IB | 25 中行永续债 02BC           | AAA     | 1.695  |
| 3.87Y+NY      | 242580035.IB | 25 中行永续债 02BC           | AAA     | 1.69   |
| 3.93Y+5Y      | 2028035.IB   | 20 浦发银行二级 04(免)         | AAA     | 1.6425 |
| 3.93Y+5Y      | 2028035.IB   | 20 浦发银行二级 04(免)         | AAA     | 1.645  |
| 3.93Y+5Y      | 2028035.IB   | 20 浦发银行二级 04(免)         | AAA     | 1.645  |
| 3.93Y+5Y      | 2028035.IB   | 20 浦发银行二级 04(免)         | AAA     | 1.6475 |
| 3.93Y+5Y      | 2028035.IB   | 20 浦发银行二级 04(免)         | AAA     | 1.6475 |
| 3.93Y+5Y      | 2028035.IB   | 20 浦发银行二级 04(免)         | AAA     | 1.65   |
| 3.93Y+5Y      | 2028035.IB   | 20 浦发银行二级 04(免)         | AAA     | 1.65   |
| 3.93Y+5Y      | 232580035.IB | 25 农行二级资本债 03A(BC)      | AAA     | 1.69   |
| 4.09Y+5Y(休 2) | 2028050.IB   | 20 工商银行二级 03(免)         | AAA     | 1.655  |
| 4.1Y+NY       | 242580053.IB | 25 渤海银行永续债 01           | AAA     | 1.84   |
| 4.1Y+NY       | 242580053.IB | 25 渤海银行永续债 01           | AAA     | 1.84   |
| 4.1Y+NY       | 242580053.IB | 25 渤海银行永续债 01           | AAA     | 1.84   |
| 4.1Y+NY       | 242580053.IB | 25 渤海银行永续债 01           | AAA     | 1.84   |

|               |              |                         |        |        |
|---------------|--------------|-------------------------|--------|--------|
| 4.1Y+5Y       | 232580046.IB | 25 农行二级资本债 04A(BC)      | AAA    | 1.7    |
| 4.1Y+NY       | 242580053.IB | 25 渤海银行永续债 01           | AAA    | 1.84   |
| 4.1Y+NY       | 242580053.IB | 25 渤海银行永续债 01           | AAA    | 1.84   |
| 4.1Y+5Y       | 232580046.IB | 25 农行二级资本债 04A(BC)      | AAA    | 1.705  |
| 4.1Y+5Y       | 232580046.IB | 25 农行二级资本债 04A(BC)      | AAA    | 1.705  |
| 4.1Y+5Y       | 232580046.IB | 25 农行二级资本债 04A(BC)      | AAA    | 1.7125 |
| 4.1Y+5Y       | 232580046.IB | 25 农行二级资本债 04A(BC)      | AAA    | 1.7125 |
| 4.17Y+5Y(休 1) | 232580056.IB | 25 广发银行二级资本债 01BC       | AAA    | 1.73   |
| 4.17Y+5Y(休 1) | 232580056.IB | 25 广发银行二级资本债 01BC       | AAA    | 1.73   |
| 4.53Y+5Y(休 1) | 232680004.IB | 26 交行二级资本债 01BC         | AAA    | 1.725  |
| 4.53Y+5Y(休 1) | 232680004.IB | 26 交行二级资本债 01BC         | AAA    | 1.725  |
| 4.53Y+5Y(休 1) | 232680004.IB | 26 交行二级资本债 01BC         | AAA    | 1.725  |
| 4.61Y+NY(休 1) | 242680009.IB | 26 交行永续债 01BC           | AAA    | 1.75   |
| 4.61Y+NY(休 1) | 242680009.IB | 26 交行永续债 01BC           | AAA    | 1.7525 |
| 4.61Y+NY(休 1) | 242680009.IB | 26 交行永续债 01BC           | AAA    | 1.7525 |
| 4.64Y+NY      | 242680012.IB | 26 邮储银行永续债 01BC         | AAA    | 1.7525 |
| 4.64Y+NY      | 242680012.IB | 26 邮储银行永续债 01BC         | AAA    | 1.7545 |
| 4.65Y+NY(休 1) | 242680013.IB | 26 工行永续债 02BC           | AAA    | 1.755  |
| 4.65Y+NY(休 1) | 242680013.IB | 26 工行永续债 02BC           | AAA    | 1.755  |
| 4.65Y+NY(休 1) | 242680013.IB | 26 工行永续债 02BC           | AAA    | 1.755  |
| 4.65Y+NY(休 1) | 242680013.IB | 26 工行永续债 02BC           | AAA    | 1.755  |
| 4.65Y+5Y      | 232680011.IB | 26 建行二级资本债 01BC         | AAA    | 1.735  |
| 4.65Y+5Y      | 232680011.IB | 26 建行二级资本债 01BC         | AAA    | 1.735  |
| 4.65Y+5Y      | 232680011.IB | 26 建行二级资本债 01BC         | AAA    | 1.735  |
| 4.65Y+5Y      | 232680011.IB | 26 建行二级资本债 01BC         | AAA    | 1.74   |
| 4.67Y+5Y(休 1) | 232680013.IB | 26 工行二级资本债 03BC         | AAA    | 1.7325 |
| 4.67Y+5Y(休 1) | 232680013.IB | 26 工行二级资本债 03BC         | AAA    | 1.7375 |
| 4.67Y+5Y(休 1) | 232680013.IB | 26 工行二级资本债 03BC         | AAA    | 1.7375 |
| 4.67Y+5Y(休 1) | 232680013.IB | 26 工行二级资本债 03BC         | AAA    | 1.7375 |
| 4.71Y+1Y(休 1) | 312610011.IB | 26 建行 TLAC 非资本债 01B(BC) | AAA    | 1.705  |
| 4.71Y+1Y(休 1) | 312610011.IB | 26 建行 TLAC 非资本债 01B(BC) | AAA    | 1.705  |
| 4.74Y+NY      | 242680028.IB | 26 工行永续债 03BC           | AAA    | 1.761  |
| 4.75Y+5Y(休 1) | 232680019.IB | 26 工行二级资本债 04BC         | AAA    | 1.735  |
| 4.75Y+5Y(休 1) | 232680019.IB | 26 工行二级资本债 04BC         | AAA    | 1.74   |
| 4.75Y+5Y(休 1) | 232680019.IB | 26 工行二级资本债 04BC         | AAA    | 1.74   |
| 4.77Y+NY      | 242680029.IB | 26 中行永续债 02BC           | AAA    | 1.7625 |
| 4.77Y+5Y      | 232680020.IB | 26 交行二级资本债 02BC         | AAAspc | 1.74   |
| 4.77Y+5Y      | 232680020.IB | 26 交行二级资本债 02BC         | AAAspc | 1.74   |
| 4.77Y+5Y      | 232680020.IB | 26 交行二级资本债 02BC         | AAAspc | 1.74   |
| 4.78Y+5Y      | 232680021.IB | 26 建行二级资本债 02BC         | AAA    | 1.74   |
| 4.85Y+5Y      | 232680029.IB | 26 工行二级资本债 05BC         | AAA    | 1.745  |
| 4.85Y+5Y      | 232680029.IB | 26 工行二级资本债 05BC         | AAA    | 1.745  |
| 4.85Y+5Y      | 232680029.IB | 26 工行二级资本债 05BC         | AAA    | 1.745  |
| 4.85Y+5Y      | 232680029.IB | 26 工行二级资本债 05BC         | AAA    | 1.7425 |
| 4.86Y+1Y(休 1) | 312610013.IB | 26 建行 TLAC 非资本债 02B(BC) | AAA    | 1.705  |
| 4.86Y+NY(休 1) | 242680038.IB | 26 中行永续债 03BC           | AAA    | 1.77   |
| 4.86Y+NY      | 242680039.IB | 26 农行永续债 01BC           | AAA    | 1.7675 |
| 4.87Y+5Y      | 232680033.IB | 26 农行二级资本债 02BC         | AAA    | 1.74   |
| 4.87Y+5Y      | 232680033.IB | 26 农行二级资本债 02BC         | AAA    | 1.74   |
| 4.87Y+5Y      | 232680033.IB | 26 农行二级资本债 02BC         | AAA    | 1.74   |
| 4.87Y+5Y      | 232680033.IB | 26 农行二级资本债 02BC         | AAA    | 1.74   |
| 4.87Y+5Y      | 232680033.IB | 26 农行二级资本债 02BC         | AAA    | 1.745  |
| 4.87Y+5Y      | 232680033.IB | 26 农行二级资本债 02BC         | AAA    | 1.745  |

|               |              |                         |     |        |
|---------------|--------------|-------------------------|-----|--------|
| 4.87Y+5Y      | 232680033.IB | 26 农行二级资本债 02BC         | AAA | 1.7475 |
| 4.9Y+1Y(休 1)  | 312610015.IB | 26 中行 TLAC 非资本债 02B(BC) | AAA | 1.71   |
| 4.91Y+NY      | 242680043.IB | 26 工行永续债 04BC           | AAA | 1.768  |
| 4.91Y+NY      | 242680043.IB | 26 工行永续债 04BC           | AAA | 1.77   |
| 4.91Y+NY      | 242680043.IB | 26 工行永续债 04BC           | AAA | 1.77   |
| 4.94Y+NY      | 242680046.IB | 26 建行永续债 02BC           | AAA | 1.77   |
| 4.94Y+NY      | 242680046.IB | 26 建行永续债 02BC           | AAA | 1.77   |
| 4.94Y+NY      | 242680046.IB | 26 建行永续债 02BC           | AAA | 1.77   |
| 4.94Y+NY      | 242680046.IB | 26 建行永续债 02BC           | AAA | 1.775  |
| 4.94Y+NY      | 242680046.IB | 26 建行永续债 02BC           | AAA | 1.7725 |
| 4.95Y+5Y      | 232680038.IB | 26 农行二级资本债 03BC         | AAA | 1.7475 |
| 4.95Y+5Y      | 232680038.IB | 26 农行二级资本债 03BC         | AAA | 1.7475 |
| 4.95Y+5Y      | 232680038.IB | 26 农行二级资本债 03BC         | AAA | 1.748  |
| 4.95Y+5Y      | 232680038.IB | 26 农行二级资本债 03BC         | AAA | 1.75   |
| 4.95Y+5Y      | 232680038.IB | 26 农行二级资本债 03BC         | AAA | 1.748  |
| 4.95Y+5Y      | 232680038.IB | 26 农行二级资本债 03BC         | AAA | 1.75   |
| 4.95Y+5Y      | 232680038.IB | 26 农行二级资本债 03BC         | AAA | 1.75   |
| 5Y+5Y         | 232680042.IB | 26 工行二级资本债 06A(BC)      | AAA | 1.75   |
| 5Y+NY         | 242680049.IB | 26 郑州银行永续债 01           | AA+ | 1.885  |
| 5Y+NY         | 242680049.IB | 26 郑州银行永续债 01           | AA+ | 1.885  |
| 5Y+5Y         | 232680042.IB | 26 工行二级资本债 06A(BC)      | AAA | 1.755  |
| 5Y+5Y         | 232680042.IB | 26 工行二级资本债 06A(BC)      | AAA | 1.7575 |
| 5Y+1Y         | 312610017.IB | 26 农行 TLAC 非资本债 03B(BC) | AAA | 1.72   |
| 5Y+5Y         | 232680042.IB | 26 工行二级资本债 06A(BC)      | AAA | 1.7525 |
| 5Y+5Y         | 232680042.IB | 26 工行二级资本债 06A(BC)      | AAA | 1.7525 |
| 5Y+5Y         | 232680042.IB | 26 工行二级资本债 06A(BC)      | AAA | 1.755  |
| 5.09Y+5Y(休 1) | 2128040.IB   | 21 中国银行二级 04(免)         | AAA | 1.7125 |
| 5.67Y+5Y      | 2228040.IB   | 22 建设银行二级 02(免)         | AAA | 1.745  |
| 6.44Y+5Y      | 232380005.IB | 23 农行二级资本债 01B(免)       | AAA | 1.79   |
| 6.45Y+5Y      | 232380010.IB | 23 建行二级资本债 01B(免)       | AAA | 1.78   |
| 7.05Y+5Y      | 232380074.IB | 23 农行二级资本债 03B(免)       | AAA | 1.8025 |
| 7.53Y+5Y      | 232480012.IB | 24 农行二级资本债 02B(免)       | AAA | 1.8275 |
| 7.53Y+5Y      | 232480012.IB | 24 农行二级资本债 02B(免)       | AAA | 1.8275 |
| 7.53Y+5Y      | 232480012.IB | 24 农行二级资本债 02B(免)       | AAA | 1.83   |
| 8.78Y+5Y      | 232580025.IB | 25 农行二级资本债 02B(BC)(免)   | AAA | 1.875  |
| 8.78Y+5Y      | 232580027.IB | 25 建行二级资本债 02B(BC)(免)   | AAA | 1.87   |
| 9.58Y+5Y      | 232680006.IB | 26 农行二级资本债 01B(BC)      | AAA | 1.905  |
| 9.58Y+5Y      | 232680006.IB | 26 农行二级资本债 01B(BC)      | AAA | 1.905  |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.925  |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.9275 |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.93   |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.9325 |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.935  |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.935  |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.935  |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.935  |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.93   |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.93   |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.9275 |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.931  |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.93   |
| 10Y+5Y        | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC)      | AAA | 1.93   |

|        |              |                    |     |        |
|--------|--------------|--------------------|-----|--------|
| 10Y+5Y | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC) | AAA | 1.93   |
| 10Y+5Y | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC) | AAA | 1.93   |
| 10Y+5Y | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC) | AAA | 1.9325 |
| 10Y+5Y | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC) | AAA | 1.935  |
| 10Y+5Y | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC) | AAA | 1.9375 |
| 10Y+5Y | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC) | AAA | 1.9375 |
| 10Y+5Y | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC) | AAA | 1.94   |
| 10Y+5Y | 232680043.IB | 26 工行二级资本债 06B(BC) | AAA | 1.94   |

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。