



【2023-01-20】

国债

2.25Y 200005 成交 2.45;9.85Y 220025 成交 2.915-2.925

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	2.1100	2.4300	2.6850	2.8350	2.9100	3.2750
今日国债(%)	2.1100	2.4300	2.6850	2.8350	2.9100	3.2750
变动(%)	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000

4.13Y 220203 成交 2.87-2.8725; 4.43Y 220208 成交 2.87-2.8725; 9.02Y 220205 成交 3.1025; 9.61Y 220311 成交 3.115; 9.76Y 220410 成交 3.14; 9.79Y 220220 成交 3.065-3.0825.

	1	3	5	7	10
昨日非国金融债(%)	2.3200	2.6800	2.9150	2.9800	3.1050
今日非国金融债(%)	2.3200	2.6800	2.9150	2.9800	3.1050
变动(%)	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
昨日国开债(%)	2.2850	2.6500	2.8700	3.0100	3.1050
今日国开债(%)	2.2850	2.6500	2.8725	3.0100	3.1050
变动(%)	0.0000	0.0000	0.0025	0.0000	0.0000

短期融资券

今日短融交投情绪受节假日影响清淡，成交主要集中在各期限 AAA AA+短融产品。短端方面，21D 072210016 22 国信证券 CP001 AAA 成交在 2.30%位置，40D 012284139 22 湘高速 SCP003 AAA 成交在 2.50 位置；长端方面，165D 072210212 22 广发证券 CP014 AAA 成交在 2.45%位置；长端方面，2354D 042380009 23 江阴公 CP001 AA+ 成交在 2.96%位置。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	2.4		2.5		2.6		2.65		2.78	
	AA+	2.7		3.06		3.18		3.3		3.5	
	AA	3.4		3.8		3.9		4.15		4.4	
	AA-	3.72		4.02		4.51		4.67		4.9	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	2.45	-5	2.53	-3	2.6	0	2.65	0	2.78	0
	AA+	2.85	-15	3.06	0	3.18	0	3.3	0	3.5	0
	AA	3.4	0	3.8	0	3.9	0	4.15	0	4.4	0
	AA-	3.72	0	4.02	0	4.51	0	4.67	0	4.9	0

中期票据

受节假日影响，今日中票交投较为清淡。1-3 年短端中票，21 泸州窖 MTN002 (AAA, 1.26Y+2.00Y) 在 2.99% (行权) 成交，低估值 3bp; 20 杭金投 MTN001 (AAA, 1.96Y) 成交在 3.50%，高估值 2.5bp。3 到 5 年期限，21 成交投 MTN001 (AAA, 3.59Y) 在估值 3.70%成交。5Y 及以上期限，几无成交。总体而言，今日中票收益率日内微有上行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.72		3.05		3.29		3.6		None	
	AAA	2.94		3.36		3.54		3.84		None	
	AA+	3.37		3.96		4.24		None		None	
	AA	3.72		4.2		4.64		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.72	0	3.06	-1	3.29	0	3.6	0	None	None
	AAA	2.95	-1	3.37	-1	3.54	0	3.84	0	None	None
	AA+	3.37	0	3.97	-1	4.24	0	None	None	None	None
	AA	3.73	-1	4.2	0	4.64	0	None	None	None	None

今日企业债交投受到节假日影响较为清淡，21 海通 02 AAA 成交在 2.74%，19 金隅 02 AAA 成交在 2.92%，总体来说，成交寥寥。

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
54D	012284323.IB	22 华电江苏 SCP030	AAA	2.46%
55D	072210162.IB	22 东财证券 CP010	AAA	2.42%
14D	012283802.IB	22 邮政 SCP002	AAA	2.35%

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
73D+NY	102000581.IB	20 中建 MTN001	AAA	2.82%
131D+5Y	101800661.IB	18 沈阳地铁 MTN001	AAA	3.73%

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
29D(休 2)	163152.SH	20CHNE02	AAA	2.38%
1.6Y	152257.SH	19 陕投 01	AAA	3.30%

文 / Derek Huang, Ethan Yuan, Teddy Chen, Oscar Wu

联系人：Yolanda Fang
邮箱：Yolanda.Fang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明：

以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和/或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN