



【2025-12-19】

国债

今日央行开展 562 亿 7 天期、1000 亿 14 天期逆回购操作，逆回购到期 1205 亿，逆回购口径资金净投放 357 亿。

国债方面 27D 250001 1.21-1.21； 2.19Y 250005 1.33-1.335； 4.10Y 250003 1.53-1.54； 6.26Y 250007 1.66-1.675； 9.68Y 250016 1.832-1.84； 29.69Y 2500006 2.22-2.249。

	1y	3y	5y	7y	10y	30y
昨日国债(%)	1.3700	1.3915	1.6050	1.7225	1.8415	2.2500
今日国债(%)	1.3525	1.3800	1.5875	1.7115	1.8330	2.2250
变动(%)	-0.0175	-0.0115	-0.0175	-0.0110	-0.0085	-0.0250

金融债

金融债方面 25D 250301 1.365-1.38； 3.16Y 240203 1.655-1.68； 6.08Y 220205 1.855-1.86； 9.50Y 250215 1.885-1.905。

	1 y	3y	5y	7y	10y
昨日非国开金融债(%)	1.5625	1.6550	1.7500	1.9425	1.9825
今日非国开金融债(%)	1.5425	1.6425	1.7400	1.9350	1.9700
变动(%)	-0.0200	-0.0125	-0.0100	-0.0075	-0.0125
昨日国开债(%)	1.5375	1.7100	1.7390	1.9150	1.9055
今日国开债(%)	1.5175	1.6925	1.7175	1.9025	1.8910
变动(%)	-0.0200	-0.0175	-0.0215	-0.0125	-0.0145

银行债

5y 大行二级今日收益率先区间内震荡，震荡后下行。非免税券前收 2.2425，今开 2.23（-0.99）.日内最高 2.23（-0.99），最低 2.21（-2.99），震荡区间 2bp，今收 2.21(-0.99),尾盘对峙为 2.21/2.20 盘中与同期限大行永续相差约 5p,券商基金为主要参与方；

五年 25 工行二级资本债 02BC 前收 2.17,今开 2.155（-0.94）,最低 2.145(-0.94）,今收 2.14 (-2.44),尾盘对峙为 2.14/2.135;

十年 25 农行二级资本债 03B(BC)昨收 2.5325,今开 2.52(-1.10),全天成交 2.52(-1.1),今收 2.52(-1.10),尾盘对峙为 2.515/2.50;

5y 股份制二永收益率下行。4.98y 华夏永续成交在 2.37（-1.68）到 2.385（-0.18），震荡区间 1.5bp。今日股份制二永成交较活跃，理财，基金有参与。

1-3y 大行二级今日成交收益率整体下行，其中 2y 大行收益率最低成交在估值-1.5 附近；1y 大行今开 1.765/1.75，成交在 1.75（-1.00），尾盘收在 1.75/1.74。2y 大行今开 1.85/1.84，成交在 1.83（-1.74），尾盘收在 1.83/1.82。今日 1-3y 大行二级交易情绪平稳，买盘力量强于卖盘，基金、券商、理财以及银行均有参与。

商金方面，1-3y 大行主要成在（-0.5）到（+0.5）。2.1y 25 农业银行三农债 01 成在 1.77（-0.37）到 1.78（+0.63）。股份制主要成在（-2）到（+0.5）。2.95y 25 兴业银行债 01 成在 1.84（-0.29）到 1.8425（-0.04）。大城商行今日主要成在（-2）到估值（+0）。科创今日主要成在估值（+0）。收益率持续走低。基金、银行、券商资管/ 基金、银行、券商资管为主。

短期融资券

今日银行间短融市场成交清淡，成交主要集中在 2026 年 Q1 期限。短端方面，89D 072510223.IB 25 东兴证券 CP004 AAA/A-1 在 1.67%成交（估值-2 位置），基金出给基金；25D 012581652.IB 25 伊利实业 SCP011(科创债) AAA 在 1.65%成交（估值位置），银行出给银行；中长端方面，147D 012582010.IB 25 巨石 SCP005(科创债) AAA 在 1.74%成交（估值位置），银行出给基金；238D 012582820.IB 25 湖南钢铁 SCP007 AAA 在 1.73%成交（估值-2 位置），理财出给基金；长端方面，362D 042580667.IB 25 西安高新 CP014 AAA 在 1.96%成交（估值位置），基金出给券商资管；309D(休 2) 042580555.IB 25 伊犁财通 CP001 AA+ 在 1.83%成交（估值-2 位置），券商资管出给基金；总体而言，短端、中长端和长端收益率下行。

中期票据

今日中票收益早盘在估值-1 左右，尾盘收在估值附近。汇金、电网成交今日较为普通，5y 汇金今日在 2.01%（-1.06）成交。汇金电网价差 0.5bp，10Y 电网今日无成交。

1-3Y，好名字整体成交在估值-3 到估值+3，1.26Y 22 亦庄控股 MTN001 成在 1.80%（-2.25），1.77Y 24 南航股 MTN009 成在 1.84%（-0.34），2.98Y 25 国盛 MTN002(科创债)1.89%（-1.05）。成交收益率集中在 1.80%-2.10%，银行、基金/ 基金、资管为主。

3-5Y，好名字整体成交在估值-3 到+2，3.08Y 24 蜀道投资 MTN001)成在 1.94%（-3.11），4.96Y 25 上实 MTN005 成在 2.11%（+0.04），4.99Y 25 华能集 MTN008 成在 2.05%（-2.11），收益率集中在 1.95%-2.05%，保险、理财/基金、券商为主。

5Y+，8.2Y 24 中车集 MTN001 成在 2.31%（-4.40）；9.42Y 25 沪港务 MTN005(转型)成在 2.43%（-0.26），成交收益率主要集中在 2.40%-2.60%附近，银行/ 保险为主。

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

企业债

交易所信用债全天交投活跃，基金，券商，保险，理财均有参与。全天收益下行。

1 年内，券商债成交在估值到估值-3（351D 24 信投 10 1.68），基金理财保险卖，基金券商卖；非券商债多成交在 1.69-1.78，（340D 21 粤电 03 1.76），基金理财保险买，基金保险卖；年内科创债今日成交寥寥（249D 25 管网 SK 1.65）。

1-3 年，今日券商债成交较少，在估值-2 附近（2.39Y 25GTH01(免) 1.80），基金保险买，基金理财卖；非券商债多成交在 1.75-1.94，（2.93Y(休 2) 25 浙交 01 1.85），基金理财买，理财银行卖。科创债成交在估值-2 到估值（2.67Y 25 杭钢 K4 1.88），券商基金理财双边参与。

3-5 年，券商债今日成交寥寥；非券商债方面今日成交活跃，成交在估值-2 到估值+0.5（4.9Y 25 京保 03 2.14），基金券商资管买，银行理财保险卖；科创方面今日成交尚可，成交多在估值-2 附近（4.84Y 华电 YK20 2.19），基金双边参与，券商资管买，银行理财卖。

5Y+，券商债成交寥寥；非券商债亦成交量尚可，成交在估值-1 到估值+1（9.33Y 25 杭城 06 2.43）；科创方面今日成交尚可，成交多在估值+1 到估值-1 附近，（9.32Y 25 国投 K1 2.36），基金双边参与，保险买，券商及其资管卖。

美元债

临近圣诞和新年假期，外币债市场交投非常清淡。

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（%）
6D	012582368.IB	25 中交三航 SCP020	AAA	1.63
6D	012582451.IB	25 苏州高新 SCP025	A	1.6
7D	012581617.IB	25 中建二局 SCP003	AAA	1.62
11D	012582905.IB	25 中化股 SCP016	AAA	1.6
11D	012582920.IB	25 中建三局 SCP006	AAA	1.6
25D	012581652.IB	25 伊利实业 SCP011(科创债)	AAA	1.65
25D	012582464.IB	25 伊利实业 SCP016	AAA	1.65
47D	012582588.IB	25 海安经开 SCP005	AA	1.86
47D	012582588.IB	25 海安经开 SCP005	AA	1.86
47D	012582588.IB	25 海安经开 SCP005	AA	1.86
64D(休 3)	042580085.IB	25 中国旅游 CP001	AAA	1.8
89D	012582945.IB	25 海安经开 SCP006	AA	1.88
89D	012582945.IB	25 海安经开 SCP006	AA	1.88
89D	012582945.IB	25 海安经开 SCP006	AA	1.88
89D	012582945.IB	25 海安经开 SCP006	AA	1.88
89D	012582945.IB	25 海安经开 SCP006	AA	1.88
89D	072510223.IB	25 东兴证券 CP004	AAA	1.67
112D	012583009.IB	25 沪电力 SCP020	AAA	100.00 净价
112D	012583009.IB	25 沪电力 SCP020	AAA	100.00 净价
112D	012583009.IB	25 沪电力 SCP020	AAA	100.00 净价
112D	012583009.IB	25 沪电力 SCP020	AAA	100.00 净价
112D	012583009.IB	25 沪电力 SCP020	AAA	100.00 净价
147D	012582010.IB	25 巨石 SCP005(科创债)	AAA	1.74
147D	012582010.IB	25 巨石 SCP005(科创债)	AAA	1.74
147D	012582010.IB	25 巨石 SCP005(科创债)	AAA	1.74
232D(休 2)	042580398.IB	25 姜堰经开 CP003	AA	1.88
232D(休 2)	042580398.IB	25 姜堰经开 CP003	AA	1.88
238D	012582820.IB	25 湖南钢铁 SCP007	AAA	1.73
238D	012582820.IB	25 湖南钢铁 SCP007	AAA	1.73
238D	012582820.IB	25 湖南钢铁 SCP007	AAA	1.73
239D(休 2)	012583100.IB	25 鲁钢铁 SCP006	AAA	1.78
273D	042580491.IB	25 高淳建设 CP008	AA	1.85
273D	042580491.IB	25 高淳建设 CP008	AA	1.85

273D	042580491.IB	25 高淳建设 CP008	AA	1.85
309D(休 2)	042580555.IB	25 伊犁财通 CP001	AA+	1.83
362D	042580667.IB	25 西安高新 CP014	AAA	1.96
362D	042580667.IB	25 西安高新 CP014	AAA	1.96

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（%）
70D+NY	102380323.IB	23 大唐发电 MTN003(能源保供特别债)	AAA	1.77 行权
90D	102100510.IB	21 川发展 MTN002A	AAA	1.67
118D	102100702.IB	21 杭州交投 MTN001	AAA	1.69
124D	102481652.IB	24 华电租赁 MTN001	AAA	1.76
124D	102481652.IB	24 华电租赁 MTN001	AAA	1.76
124D	102481652.IB	24 华电租赁 MTN001	AAA	1.76
168D	102482165.IB	24 昆明轨道 MTN002	AAA	2.12
200D	102381617.IB	23 杭州国资 MTN001	AAA	1.74
206D	102381655.IB	23 新海连 MTN002	AA+	1.83
227D	102381911.IB	23 南京地铁 MTN001	AAA	1.72
227D	102381911.IB	23 南京地铁 MTN001	AAA	1.72
241D+NY	102382108.IB	23 中电投 MTN035B	AAA	1.77 行权
270D+2Y	102382470.IB	23 珠海水务 MTN001	AA+	1.77 行权
270D+2Y	102382470.IB	23 珠海水务 MTN001	AA+	1.77 行权
302D+2Y	102382732.IB	23 青岛国信 MTN007B	AAA	1.84 行权
311D	102480058.IB	24 津城建 MTN002	AAA	1.77
312D+2Y	102382919.IB	23 星城发展 MTN002	AA+	1.80 行权
319D	102382994.IB	23 常德城投 MTN004	AA+	1.81
320D	102102255.IB	21 苏国信 MTN012	AAA	1.71
338D(休 1)	102180039.IB	21 皖能源 MTN002	AAA	1.69
345D(休 1)	102383200.IB	23 建安投资 MTN005	AA+	1.8
364D	102383370.IB	23 闽西兴杭 MTN002	AAA	1.75
1.07Y	102280078.IB	22 雨花城投 MTN001	AA+	1.81
1.21Y	102480651.IB	24 富和建设 MTN002	AA	1.91
1.23Y	132480020.IB	24 南京地铁 GN002(碳中和债)	AAA	1.75
1.27Y(休 2)	102481215.IB	24 保利发展 MTN003	AAA	2.35
1.33Y(休 2)	102481537.IB	24 苏州交投 MTN001(乡村振兴)	AAA	1.81
1.33Y	102481658.IB	24 光明 MTN001	AAA	1.77
1.35Y	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA	1.73
1.43Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	1.78
1.43Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	1.78
1.5Y	102482401.IB	24 中色 MTN002	AAA	1.83
1.52Y	102482707.IB	24 沪建房产 MTN001	AA+	2.04
1.52Y	102482716.IB	24 汇金 MTN004	AAA	1.75
1.59Y(休 2)	102483150.IB	24 义乌国资 MTN004	AAA	1.85
1.59Y(休 2)	102483150.IB	24 义乌国资 MTN004	AAA	1.85
1.69Y(休 2)	102483858.IB	24 电网 MTN005	AAA	1.785
1.71Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	1.79
1.73Y	102484099.IB	24 水发集团 MTN009	AAA	2.38
1.75Y+NY(休 2)	102484080.IB	24 中色 MTN003	AAA	1.99 行权
1.85Y(休 1)	102584452.IB	25 中交集 MTN002	AAA	1.835
1.85Y(休 1)	102584452.IB	25 中交集 MTN002	AAA	1.835
1.88Y(休 2)	102484822.IB	24 青岛城投 MTN007	AAA	1.93
1.92Y(休 2)	102485028.IB	24 南航股 MTN013	AAA	1.86
1.92Y+NY(休 1)	102485005.IB	24 中色 MTN005	AAA	2.04 行权
1.94Y+NY	102485139.IB	24 越秀集团 MTN009	AAA	2.03 行权

1.94Y+NY	102485139.IB	24 越秀集团 MTN009	AAA	2.03 行权
1.94Y+NY	102485139.IB	24 越秀集团 MTN009	AAA	2.03 行权
1.96Y	102485294.IB	24 闽投 MTN009	AAA	1.85
1.98Y(休 2)	102485355.IB	24 天津港 MTN005(科创票据)	AAA	1.99
2.17Y	102580611.IB	25 北京国资 MTN001	AAA	1.84
2.27Y(休 1)	102581325.IB	25 河南农投 MTN001	AAA	100.00 净价
2.33Y	102581705.IB	25 光明 MTN001	AAA	1.865
2.33Y	102581705.IB	25 光明 MTN001	AAA	1.87
2.33Y	102581705.IB	25 光明 MTN001	AAA	1.87
2.36Y(休 4)	102581981.IB	25 嘉公路 MTN002	AA+	1.98
2.69Y+2Y	102583658.IB	25 鹰潭国控 MTN002A	AA+	2.21 行权
2.74Y+2Y(休 1)	102583873.IB	25 朝阳国资 MTN003A	AAA	1.92 行权
2.76Y	102382600.IB	23 北控水务 MTN001	AAA	1.93
2.83Y	102584232.IB	25 北控 MTN001	AAA	1.92
2.84Y(休 1)	102584355.IB	25 萧山机场 MTN001A	AAA	1.91
2.87Y	102382987.IB	23 锦江国际 MTN001	AAA	1.93
2.96Y	102383240.IB	23 济南城投 MTN003A	AAA	1.98
2.96Y	102383240.IB	23 济南城投 MTN003A	AAA	1.98
2.98Y(休 1)	102585152.IB	25 青岛国信 MTN008	AAA	2.01
2.98Y	102585185.IB	25 豫航空港 MTN006	AAA	100.00 净价
2.98Y	102585185.IB	25 豫航空港 MTN006	AAA	100.00 净价
2.98Y	102585185.IB	25 豫航空港 MTN006	AAA	100.00 净价
2.99Y	102585215.IB	25 浙江新能 MTN001	AAA	2.1
3.06Y+2Y	102480062.IB	24 诚通控股 MTN001A	AAA	1.91 行权
3.07Y	102480135.IB	24 乌城投 MTN001B	AAA	1.975
3.08Y	102480222.IB	24 渝高速 MTN001	AAA	1.95
3.08Y	102480222.IB	24 渝高速 MTN001	AAA	1.95
3.08Y	102480222.IB	24 渝高速 MTN001	AAA	1.95
3.1Y	102480311.IB	24 蓉城轨交 MTN001	AAA	1.91
3.23Y	102400656.IB	24 中交投 MTN002	AAA	2
3.23Y	102400656.IB	24 中交投 MTN002	AAA	2
3.42Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	1.925
3.42Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	1.925
3.56Y	102482933.IB	24 咸阳城发 MTN001	BBB+	2.67
3.57Y	102483022.IB	24 国联 MTN007	AAA	2.03
3.66Y	102483555.IB	24 景国资 MTN003	AA+	2.62
3.87Y	102484728.IB	24 启东城投 MTN002	AA+	101.3639 净价
4.58Y	102580348.IB	25 电网 MTN004	AAA	2.02
4.64Y	102583343.IB	25 皖投集 MTN003	AAA	2.135
4.67Y	102583531.IB	25 嘉兴滨海 MTN003	AA+	2.38
4.73Y	102583816.IB	25 汇金 MTN005	AAA	2.01
4.73Y	102583816.IB	25 汇金 MTN005	AAA	2.01
4.73Y	102583816.IB	25 汇金 MTN005	AAA	2.01
4.73Y	102583816.IB	25 汇金 MTN005	AAA	2.01
4.74Y(休 1)	102583863.IB	25 光大集团 MTN006A	AAA	2.04
4.82Y	102584194.IB	25 广州地铁 MTN009	AAA	2.04
4.92Y	102501690.IB	25 潍坊投资 MTN004B	AA+	2.96
4.99Y	102585271.IB	25 华能集 MTN008	AAA	2.05
4.99Y	102585271.IB	25 华能集 MTN008	AAA	2.05
5Y	102585283.IB	25 粤交投 MTN003	AAA	2.065
5.34Y	102584376.IB	25 电网 MTN033	AAA	2.0541
5.34Y	102584376.IB	25 电网 MTN033	AAA	2.0541
7.98Y(休 1)	102383298.IB	23 中信集团 MTN005B	AAA	2.34
8.57Y(休 2)	102483026.IB	24 南昌建投 MTN005	AAA	2.56
8.57Y(休 2)	102483026.IB	24 南昌建投 MTN005	AAA	2.56

200D	188356.SH	21 产发 01	AAA	1.74
208D	2422040.IB	24 招联消费金融债 05	AAA	1.67
210D	115578.SH	23 洪政 02	AAA	1.76
212D+NY(休 1)	115683.SH	23 首钢 Y2	AAA	1.82 行权
214D	188432.SH	21 国君 G8	AAA	1.65
220D	115722.SH	23 信投 C6	AAA	1.66
221D+NY	148400.SZ	23 鞍钢 KY05	AAA	1.83 行权
221D+NY	148400.SZ	23 鞍钢 KY05	AAA	1.83 行权
236D	188568.SH	21 招证 10	AAA	1.65
240D(休 1)	252028.SH	23 兴业 F2	AAA	1.68
251D	188648.SH	21 中泰 03	AAA	1.66
254D+4Y	270107.SH	23 萍创债	AA+	1.97 行权
274D(休 1)	280149.SH	25 景城 D2	AA	2.13
278D	280141.SH	25 咸高 03	AA	2.06
278D	280141.SH	25 咸高 03	AA	2.06
325D	184108.SH	21 福能 01	AAA	1.74
325D	184108.SH	21 福能 01	AAA	1.74
325D	2180445.IB	21 闽能源债 01	AAA	1.74
351D(休 2)	242028.SH	24 信投 10	AAA	1.68
1.02Y	184181.SH	G21 西轨 2	AAA	1.78
1.02Y	184181.SH	G21 西轨 2	AAA	1.78
1.08Y	185236.SH	22 中豫 01	AAA	1.79
1.1Y+5Y(休 2)	185347.SH	22 中车 G1	AAA	1.75 行权
1.22Y+2Y	148627.SZ	24 广州数字科技 K1	AAAk	1.73 行权
1.23Y(休 1)	240671.SH	24 中电 01	AAA	1.8
1.24Y	185506.SH	22 浙商 G2	AAA	1.85
1.24Y	185506.SH	22 浙商 G2	AAA	1.85
1.26Y+NY	185600.SH	22 光证 Y3	AAA	1.83 行权
1.26Y+NY	185600.SH	22 光证 Y3	AAA	1.83 行权
1.26Y	240768.SH	24 疏浚 K1	AAA	1.73
1.27Y(休 2)	524196.SZ	25 申证 03	AAA	1.72
1.32Y+2Y(休 1)	254163.SH	24 盐城债	AA+	2.13 行权
1.32Y+2Y(休 1)	254163.SH	24 盐城债	AA+	2.13 行权
1.33Y+2Y	032480409.IB	24 沪地产 PPN001(保障性住房平急两用)	AAA	1.98 行权
1.34Y	148705.SZ	24 东莞 01	AAA	1.84
1.34Y	2422019.IB	24 工银金租债 03	AAA	1.78
1.34Y	2422019.IB	24 工银金租债 03	AAA	1.78
1.35Y(休 1)	240946.SH	24 建材 K2	AAA	1.73
1.51Y+2Y(休 1)	241175.SH	24 厦轨 01	AAA	1.815 行权
1.51Y+2Y(休 1)	241175.SH	24 厦轨 01	AAA	1.815 行权
1.51Y+2Y(休 1)	241175.SH	24 厦轨 01	AAA	1.815 行权
1.51Y+2Y(休 1)	241175.SH	24 厦轨 01	AAA	1.815 行权
1.51Y+2Y(休 1)	241175.SH	24 厦轨 01	AAA	1.815 行权
1.51Y+2Y(休 1)	241175.SH	24 厦轨 01	AAA	1.815 行权
1.51Y+2Y(休 1)	241175.SH	24 厦轨 01	AAA	1.815 行权
1.51Y+2Y(休 1)	241175.SH	24 厦轨 01	AAA	1.815 行权
1.51Y+2Y(休 1)	241175.SH	24 厦轨 01	AAA	1.815 行权
1.51Y+2Y(休 1)	241175.SH	24 厦轨 01	AAA	1.815 行权
1.64Y+6Y	148855.SZ	24 粤财 01	AAA	1.83 行权
1.68Y+1Y(休 2)	243670.SH	25 中金 G3	AAA	1.77 行权
1.7Y	152566.SH	20 定西债	AA	2.65
1.7Y	152566.SH	20 定西债	AA	2.65
1.7Y	152566.SH	20 定西债	AA	2.65
1.76Y	241656.SH	24 宁兴 01	AA+	1.95
1.84Y	280310.SH	25 信投 F3	AAA	1.95

1.84Y+2Y	148952.SZ	24 宝安投资 01	AAA	1.89 行权
1.85Y(休 1)	255964.SH	24 柯资 05	AA+	1.98
1.87Y+NY	138510.SH	22 山能 Y4	AAA	102.989 净价
1.88Y(休 1)	244168.SH	25 中证 12	AAA	1.8
1.88Y(休 1)	244168.SH	25 中证 12	AAA	1.8
1.92Y	280743.SH	25 银河 F5	AAA	1.96
1.92Y(休 1)	138598.SH	22 华泰 G7	AAA	1.78
1.94Y	242049.SH	24 京投 K8	AAA	1.72
1.96Y(休 1)	138610.SH	22 财金 01	AAA	1.89
1.96Y(休 1)	138610.SH	22 财金 01	AAA	1.89
1.96Y(休 1)	138610.SH	22 财金 01	AAA	1.89
1.96Y(休 1)	138610.SH	22 财金 01	AAA	1.89
1.96Y(休 1)	138610.SH	22 财金 01	AAA	1.89
1.96Y(休 1)	138610.SH	22 财金 01	AAA	1.89
1.98Y	032481594.IB	24 豫航空港 PPN006	AAA	2.19
1.98Y	242139.SH	24 闽金 01	AAA	1.85
1.99Y+2Y	242163.SH	24 金隅 K3	AAA	1.86 行权
2Y	524080.SZ	24 广建 03	AAA	2.1
2.08Y+2Y	242328.SH	25 宁发 02	AA+	2.06 行权
2.21Y	242486.SH	25 中证 G1	AAA	1.81
2.22Y+NY	148203.SZ	23 光大 Y2	AAA	1.86 行权
2.24Y+2Y(休 1)	257818.SH	25 发控 03	AAA	2.12 行权
2.31Y+NY	148240.SZ	23 光大 Y4	AAA	1.87 行权
2.32Y	115202.SH	23 中财 G2	AAA	1.84
2.33Y	242805.SH	25 沪国 03	AAA	1.86
2.39Y	242969.SH	25GTHT01	AAA	1.8
2.43Y	251147.SH	23 两江 04	AAA	2.07
2.62Y+2Y	524385.SZ	25 广州数字科技 K1	AAAk	1.90 行权
2.62Y+2Y	524385.SZ	25 广州数字科技 K1	AAAk	1.90 行权
2.62Y+2Y	524385.SZ	25 广州数字科技 K1	AAAk	1.90 行权
2.65Y(休 2)	243412.SH	25 杭水 01	AAA	1.87
2.65Y(休 2)	243412.SH	25 杭水 01	AAA	1.87
2.67Y	243397.SH	25 杭钢 K4	AAA	1.88
2.67Y	243397.SH	25 杭钢 K4	AAA	1.88
2.67Y	243397.SH	25 杭钢 K4	AAA	1.88
2.67Y	243397.SH	25 杭钢 K4	AAA	1.88
2.67Y	243397.SH	25 杭钢 K4	AAA	1.88
2.75Y	243794.SH	25 国能 K3	AAA	1.8
2.84Y	243910.SH	25 华鑫 04	AA+	2.1
2.87Y	244097.SH	25 青信 09	AAA	2
2.92Y	244258.SH	25 华安 C2	AAA	2.14
2.93Y(休 2)	244259.SH	25 浙交 01	AAA	1.85
2.93Y(休 2)	244259.SH	25 浙交 01	AAA	1.85
2.93Y(休 2)	244259.SH	25 浙交 01	AAA	1.85
2.93Y(休 2)	244325.SH	25 财信 02	AAA	1.97
2.96Y	149321.SZ	20 青城 06	AAA	2
2.99Y	148550.SZ	23 国证 13	AAA	1.8
3Y	244430.SH	25HDGJK1		1.87
3.22Y	254045.SH	24 武侯 01	AA+	2.26
3.23Y	148643.SZ	24 鲲鹏 02	AAA	1.97
3.23Y	240696.SH	24 翔业 02	AAA	1.92
3.27Y	240803.SH	24 兵器 K1	AAA	1.86
3.27Y	2280128.IB	22 相高债 01	AA	2.05
3.34Y	254467.SH	24 钱塘 K2	AA+	2.2
3.42Y(休 1)	148738.SZ	24 路桥 K3	AAA	1.94

3.52Y	241168.SH	24 东证 C1	AAA	2.11
3.52Y	241168.SH	24 东证 C1	AAA	2.11
3.52Y+NY	282480001.IB	24 中英人寿永续债 01	AAA	2.47 行权
3.52Y+NY	282480001.IB	24 中英人寿永续债 01	AAA	2.47 行权
3.52Y+NY	282480001.IB	24 中英人寿永续债 01	AAA	2.47 行权
3.52Y+NY	282480001.IB	24 中英人寿永续债 01	AAA	2.47 行权
3.52Y+NY	282480001.IB	24 中英人寿永续债 01	AAA	2.47 行权
3.58Y	032480714.IB	24 十堰城控 PPN002	AA+	2.54
3.59Y	148828.SZ	24 顺控 03	A-	2.04
3.59Y	148828.SZ	24 顺控 03	A-	2.04
3.6Y	241332.SH	24 恒健 05	AAA	1.9
3.65Y+2Y	032480854.IB	24 广州城建 PPN001B	AAA	2.19 行权
3.69Y	255673.SH	24 金国 02	AAA	2.2
3.77Y+5Y	272400007.IB	24 中国人寿资本补充债 01BC	AAA	2.20 行权
3.92Y	256527.SH	24 冀交 07	AAA	2.23
3.96Y+NY	282480011.IB	24 平安人寿永续债 01	AAA	2.42 行权
4.07Y	257234.SH	25 外滩 02	AAA	2.28
4.1Y	242350.SH	25 蜀道 01	AAA	2.08
4.54Y+NY	243250.SH	建材 YK18	AAA	2.15 行权
4.55Y+NY(休 1)	243264.SH	中化 KY01	AAA	2.35 行权
4.6Y	259488.SH	25 株国 13	AA+	2.79
4.65Y	524400.SZ	25SCNYK1	AAA	2.05
4.84Y+NY	244047.SH	华电 YK20	AAA	2.19 行权
4.9Y+20Y	244144.SH	25 京保 03	AAA	2.14 行权
4.9Y	244193.SH	25 京投 K5	AAA	1.97
4.9Y	244193.SH	25 京投 K5	AAA	1.97
4.9Y	524530.SZ	25BOEK3	AAA	2.1
4.91Y(休 1)	244213.SH	25HPI01K	AAA	1.96
4.92Y	524534.SZ	25 越资 08	AAA	2.17
4.92Y	524534.SZ	25 越资 08	AAA	2.17
4.92Y+5Y	272580008.IB	25 平安产险资本补充债 01	AAA	2.43 行权
4.92Y+5Y	272580008.IB	25 平安产险资本补充债 01	AAA	2.43 行权
4.92Y+5Y	272580008.IB	25 平安产险资本补充债 01	AAA	2.43 行权
4.92Y+5Y	272580008.IB	25 平安产险资本补充债 01	AAA	2.43 行权
4.93Y(休 1)	244291.SH	25 船舶 K3	AAA	1.96
4.93Y(休 1)	244291.SH	25 船舶 K3	AAA	1.96
4.93Y(休 1)	244291.SH	25 船舶 K3	AAA	1.96
4.93Y(休 1)	244291.SH	25 船舶 K3	AAA	1.96
4.98Y+5Y	272580009.IB	25 平安人寿资本补充债 01	AAA	2.405 行权
4.98Y+5Y	272580009.IB	25 平安人寿资本补充债 01	AAA	2.405 行权
4.98Y+5Y	272580009.IB	25 平安人寿资本补充债 01	AAA	2.405 行权
4.98Y+5Y	272580009.IB	25 平安人寿资本补充债 01	AAA	2.405 行权
8.33Y	240918.SH	24 焦煤 K1	AAA	2.46
8.33Y	240918.SH	24 焦煤 K1	AAA	2.46
8.33Y	240918.SH	24 焦煤 K1	AAA	2.46
8.33Y	240918.SH	24 焦煤 K1	AAA	2.46
8.64Y	241378.SH	24 节能 K2	AAA	2.49
8.64Y	241395.SH	24 赣交 K1	AAA	2.3
8.64Y	241395.SH	24 赣交 K1	AAA	2.3
8.64Y	241395.SH	24 赣交 K1	AAA	2.3
9.32Y(休 2)	242745.SH	25 国投 K1	AAA	2.36
9.33Y	242461.SH	25 杭城 06	AAA	2.43
9.88Y	243950.SH	甬通商 K5	AAA	2.43
9.88Y	243950.SH	甬通商 K5	AAA	2.43
9.92Y	524541.SZ	25 诚通 K1	AAA	2.42

170D+5Y(休 2)	2120047.IB	21 宁波银行 二级 01	AAA	1.715 行权
170D+5Y(休 2)	2120047.IB	21 宁波银行 二级 01	AAA	1.72 行权
205D(休 1)	2320026.IB	23 徽商银行	AAA	1.68
205D(休 1)	2320026.IB	23 徽商银行	AAA	1.68
213D	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	1.625
213D	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	1.625
213D	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	1.625
213D	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	1.625
213D	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	1.625
213D	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	1.6275
218D(休 2)	212380009.IB	23 长沙银行债 01	AAA	1.65
281D(休 2)	212380021.IB	23 交行债 02	AAA	1.67
281D(休 2)	212380021.IB	23 交行债 02	AAA	1.67
325D	212380023.IB	23 光大银行债 03	AAA	1.64
330D(休 2)	2320055.IB	23 三峡银行小微债	AA+	1.755
332D+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	1.735 行权
332D+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	1.74 行权
332D+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	1.74 行权
336D	2320058.IB	23 赣州银行绿色债	AA+	1.75
336D	2320058.IB	23 赣州银行绿色债	AA+	1.75
342D+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	1.76 行权
360D+5Y(休 1)	2128049.IB	21 建设银行 二级 05	AAA	1.75 行权
1.07Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行 二级 01	AAA	1.765 行权
1.07Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行 二级 01	AAA	1.765 行权
1.08Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	1.76 行权
1.1Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行 二级 01	AAA	1.75 行权
1.18Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	1.77 行权
1.19Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行 二级 01	AAA	1.755 行权
1.19Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行 二级 01	AAA	1.755 行权
1.21Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	1.695
1.22Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行 二级 01	AAA	1.76 行权
1.25Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	1.7
1.25Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	1.7
1.25Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	1.7
1.27Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02	AAA	1.7
1.32Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行 二级 03	AAA	1.76 行权
1.32Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行 二级 03	AAA	1.76 行权
1.32Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行 二级 03	AAA	1.77 行权
1.35Y(休 1)	212400004.IB	24 光大银行小微债	AAA	1.7
1.35Y(休 1)	212400004.IB	24 光大银行小微债	AAA	1.71
1.35Y(休 1)	212400004.IB	24 光大银行小微债	AAA	1.71
1.35Y	2420016.IB	24 北京银行 02	AAA	1.73
1.35Y	2420016.IB	24 北京银行 02	AAA	1.735
1.41Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.81 行权
1.42Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.795 行权
1.42Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.81 行权
1.5Y	212400005.IB	24 成都农商行三农债 01	AAA	1.77
1.56Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.735
1.69Y	2420039.IB	24 广州银行小微债 01	AAA	1.79
1.72Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA	1.77
1.77Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	AAA	1.74
1.77Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	AAA	1.74
1.85Y+5Y	092280108.IB	22 中行 二级资本债 02A	AAA	1.825 行权
1.85Y+5Y	092280108.IB	22 中行 二级资本债 02A	AAA	1.83 行权
1.89Y+5Y	092280134.IB	22 工行 二级资本债 04A	AAA	1.83 行权

1.89Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	1.83 行权
1.89Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	1.855 行权
1.89Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	1.855 行权
2.01Y+5Y	232280007.IB	22 工行二级资本债 05A	AAA	1.86 行权
2.1Y(休 1)	2528001.IB	25 农业银行三农债 01	AAA	1.78
2.26Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.88 行权
2.26Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	1.88 行权
2.26Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	1.88 行权
2.26Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	1.88 行权
2.26Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	1.88 行权
2.26Y	212500016.IB	25 光大银行债 01	AAA	1.785
2.26Y	212500016.IB	25 光大银行债 01	AAA	1.785
2.31Y+5Y	232380014.IB	23 天津银行二级资本债 01	AAA	2.34 行权
2.31Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA	1.87 行权
2.31Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA	1.87 行权
2.35Y+5Y	232380020.IB	23 稠州商行二级资本债 01	AA+	2.44 行权
2.42Y(休 2)	2520012.IB	25 上海银行科创债 01	AAA	1.8
2.42Y(休 2)	2520012.IB	25 上海银行科创债 01	AAA	1.805
2.44Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01	AAA	1.94 行权
2.49Y+1Y(休 3)	312510001.IB	25 交行 TLAC 非资本债 01A(BC)	AAA	1.9025 行权
2.59Y+1Y	312510007.IB	25 交行 TLAC 非资本债 02A(BC)	AAA	1.91 行权
2.63Y+1Y(休 1)	312510009.IB	25 农行 TLAC 非资本债 02A(BC)	AAA	1.905 行权
2.63Y+1Y(休 1)	312510009.IB	25 农行 TLAC 非资本债 02A(BC)	AAA	1.91 行权
2.63Y+1Y(休 1)	312510009.IB	25 农行 TLAC 非资本债 02A(BC)	AAA	1.91 行权
2.65Y+NY	242380015.IB	23 成都农商行永续债 01	AAA	2.06 行权
2.7Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.91 行权
2.7Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.915 行权
2.7Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.915 行权
2.7Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.915 行权
2.7Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.915 行权
2.7Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.92 行权
2.74Y+5Y	232380052.IB	23 农行二级资本债 02A	AAA	1.91 行权
2.76Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	1.915 行权
2.85Y+1Y	312510013.IB	25 工行 TLAC 非资本债 01BC	AAA	1.975 行权
2.85Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.925 行权
2.85Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.925 行权
2.85Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.925 行权
2.85Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.93 行权
2.85Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.93 行权
2.85Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.93 行权
2.85Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.96 行权
2.86Y	292580013.IB	25 联昌银行债 01BC	AAA	2.175
2.87Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA	1.93 行权
2.87Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA	1.935 行权
2.91Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	1.925 行权
2.95Y	212580050.IB	25 兴业银行债 01	AAA	1.84
2.95Y	212580050.IB	25 兴业银行债 01	AAA	1.8425
2.95Y	212580050.IB	25 兴业银行债 01	AAA	1.8425
2.95Y	2528028.IB	25 兴业银行绿色债 03	AAA	99.7429 净价
2.95Y+1Y(休 2)	312510016.IB	25 农行 TLAC 非资本债 03A(BC)	AAA	1.9825 行权
2.98Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.84

2.98Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.84
2.98Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.84
2.98Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.84
2.98Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.84
2.98Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.84
2.98Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.8425
2.98Y	2528034.IB	25 浦发银行 04	AAA	1.9
2.98Y	2528034.IB	25 浦发银行 04	AAA	1.9
3.12Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	1.95 行权
3.13Y+5Y(休 1)	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A	AAA	1.96 行权
3.13Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.965 行权
3.13Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.965 行权
3.13Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.965 行权
3.13Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.965 行权
3.24Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.04 行权
3.24Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.05 行权
3.3Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	1.975 行权
3.3Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	1.975 行权
3.33Y+5Y	232480010.IB	24 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.07 行权
3.33Y+5Y	232480010.IB	24 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.07 行权
3.35Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.095 行权
3.35Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	1.98 行权
3.35Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	1.98 行权
3.45Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.15 行权
3.45Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.15 行权
3.45Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.15 行权
3.46Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.085 行权
3.48Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.155 行权
3.48Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.155 行权
3.5Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.15 行权
3.5Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.15 行权
3.5Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.15 行权
3.55Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.03 行权
3.55Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.035 行权
3.56Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.09 行权
3.6Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.0375 行权
3.6Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.0375 行权
3.61Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.12 行权
3.64Y+5Y	232480050.IB	24 上海银行二级资本债 01	AAA	2.12 行权
3.66Y+5Y	1928020.IB	19 交通银行二级 02	AAA	2.05 行权
3.68Y+5Y	232400036.IB	24 南京银行二级资本债 02	AAA	2.12 行权
3.68Y+5Y	232400036.IB	24 南京银行二级资本债 02	AAA	2.12 行权
3.69Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.115 行权
3.69Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.12 行权
3.69Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.12 行权
3.69Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.12 行权
3.69Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.125 行权
3.86Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	2.07 行权
3.86Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	2.07 行权
3.88Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	2.185 行权
3.88Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	2.185 行权
3.88Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	2.185 行权
3.88Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	2.185 行权
3.94Y+NY	242480082.IB	24 农行永续债 03BC	AAA	2.165 行权
3.98Y+5Y(休 1)	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A	AAA	2.14 行权

4.03Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	2.10 行权
4.03Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	2.11 行权
4.2Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.12 行权
4.2Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.12 行权
4.2Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.12 行权
4.2Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.1225 行权
4.2Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.13 行权
4.2Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.13 行权
4.2Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.13 行权
4.2Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.13 行权
4.2Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.13 行权
4.21Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	2.3 行权
4.27Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.27Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.27Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.27Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.27Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.27Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.27Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.27Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.27Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.27Y+NY	242500036.IB	25 杭州银行永续债 01	AAA	2.26 行权
4.32Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.28 行权
4.32Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.28 行权
4.32Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.28 行权
4.36Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.145 行权
4.36Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.1475 行权
4.36Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.15 行权
4.36Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.155 行权
4.36Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.155 行权
4.36Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.155 行权
4.41Y+5Y(休 2)	232580009.IB	25 中信银行二级资本债 01BC	AAA	2.19 行权
4.41Y+5Y(休 2)	232580009.IB	25 中信银行二级资本债 01BC	AAA	2.1925 行权
4.41Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.21 行权
4.41Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.215 行权
4.41Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.215 行权
4.41Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.215 行权
4.41Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.215 行权
4.42Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.29 行权
4.42Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.29 行权
4.42Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.29 行权
4.42Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.29 行权
4.43Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.1425 行权
4.43Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.1425 行权
4.43Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.145 行权
4.43Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.155 行权
4.44Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC	AAA	2.25 行权
4.44Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.215 行权
4.44Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.215 行权
4.44Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.215 行权
4.44Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.22 行权
4.44Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.22 行权
4.48Y+NY	242580018.IB	25 江苏银行永续债 02BC	AAA	2.295 行权
4.48Y+NY	242580018.IB	25 江苏银行永续债 02BC	AAA	2.295 行权
4.48Y+NY	242580018.IB	25 江苏银行永续债 02BC	AAA	2.295 行权
4.49Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.1475 行权
4.49Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.15 行权

4.51Y+NY(休 1)	242580022.IB	25 民生银行永续债 01	AAA	2.45 行权
4.56Y+NY	242580026.IB	25 浦发银行永续债 02	AAA	2.27 行权
4.56Y+NY	242580026.IB	25 浦发银行永续债 02	AAA	2.27 行权
4.59Y+5Y	232580024.IB	25 农行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.1525 行权
4.59Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.225 行权
4.59Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.225 行权
4.68Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.25 行权
4.68Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.255 行权
4.68Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.255 行权
4.68Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.255 行权
4.68Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.255 行权
4.74Y+NY	242580042.IB	25 宁波银行永续债 01	AAA	2.35 行权
4.75Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.335 行权
4.75Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.335 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.205 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.2125 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.2125 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.2125 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.215 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.215 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.215 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.215 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.215 行权
4.75Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.215 行权
4.86Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AAA	2.26 行权
4.86Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AAA	2.26 行权
4.86Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AAA	2.26 行权
4.91Y+5Y	2028050.IB	20 工商银行二级 03	AAA	2.16 行权
4.91Y+5Y	2028050.IB	20 工商银行二级 03	AAA	2.16 行权
4.91Y+5Y	2028050.IB	20 工商银行二级 03	AAA	2.17 行权
4.91Y+5Y	2028050.IB	20 工商银行二级 03	AAA	2.18 行权
4.92Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.21 行权
4.92Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.215 行权
4.92Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.215 行权
4.92Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.92Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.94Y+NY	242580057.IB	25 杭州银行永续债 02	AAA	2.37 行权
4.94Y+NY	242580057.IB	25 杭州银行永续债 02	AAA	2.37 行权
4.94Y+NY	242580057.IB	25 杭州银行永续债 02	AAA	2.37 行权
4.94Y+NY	242580057.IB	25 杭州银行永续债 02	AAA	2.37 行权
4.94Y+NY	242580057.IB	25 杭州银行永续债 02	AAA	2.37 行权
4.94Y+NY	242580057.IB	25 杭州银行永续债 02	AAA	2.37 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580051.IB	25 长沙银行二级资本债 01	AAA	2.435 行权
4.95Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.37 行权
4.95Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.37 行权
4.95Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.37 行权
4.95Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.38 行权
4.95Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.38 行权
4.95Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.38 行权

4.95Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.385 行权
4.96Y+5Y	232580053.IB	25 成都农商行二级资本债 01	AAA	2.435 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.21 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.21 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.21 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2125 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.215 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.215 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.215 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.215 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.215 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.215 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.215 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2175 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2175 行权
4.97Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.23 行权
4.97Y+5Y(休 1)	232580055.IB	25 徽商银行二级资本债 01	AAA	2.405 行权
4.97Y+5Y(休 1)	232580055.IB	25 徽商银行二级资本债 01	AAA	2.415 行权
5.99Y+5Y(休 1)	2128050.IB	21 建设银行二级 06	AAA	2.27 行权
8.66Y+5Y	232480053.IB	24 浦发银行二级资本债 01B	AAA	2.54 行权
8.66Y+5Y	232480053.IB	24 浦发银行二级资本债 01B	AAA	2.54 行权
8.98Y+5Y(休 2)	232480099.IB	24 浦发银行二级资本债 02B	AAA	2.575 行权
8.98Y+5Y(休 2)	232480099.IB	24 浦发银行二级资本债 02B	AAA	2.575 行权
9.49Y+5Y(休 1)	232580017.IB	25 农行二级资本债 01B(BC)	AAA	2.485 行权
9.59Y+5Y	232580025.IB	25 农行二级资本债 02B(BC)	AAA	2.48 行权
9.59Y+5Y	232580025.IB	25 农行二级资本债 02B(BC)	AAA	2.48 行权
9.75Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AAA	2.52 行权
9.75Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AAA	2.52 行权
9.75Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AAA	2.525 行权

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。