

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

【2023-04-01】

国债

中国央行今日开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率持平 1.8%。今日有 500 亿元 7 天期逆回购到期。资金面整体均衡。

国债方面 210D 230024 1.695 -1.70； 351D 230005 1.75； 2.63Y 230025 2.05-2.055； 4.55Y 230022 2.20-2.22； 6.74Y 230028 2.335-2.355； 9.66Y 230026 2.345-2.359； 29.05Y 230009 2.525-2.539。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.6750	2.0375	2.2000	2.3300	2.3800	2.5100
今日国债(%)	1.6950	2.0550	2.2275	2.3500	2.3960	2.5350
变动(%)	0.0200	0.0175	0.0275	0.0200	0.0160	0.0250

金融债

金融债方面 162D(休 2) 230211 1.85； 299D 240301 1.85-1.87； 2.91Y 220203 2.1775-2.18； 4.46Y 230415 2.3375-2.345； 6.22Y 200210 2.4275-2.43； 9.45Y 230215 2.49-2.51。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.7800	2.1550	2.3200	2.4600	2.4900
今日非国开金融债(%)	1.8000	2.1650	2.3380	2.4800	2.5075
变动(%)	0.0200	0.0100	0.0180	0.0200	0.0175
昨日国开债(%)	1.8250	2.1350	2.2475	2.4100	2.4500
今日国开债(%)	1.8500	2.1550	2.2660	2.4300	2.4725
变动(%)	0.0250	0.0200	0.0185	0.0200	0.0225

短期融资券

今日银行间短融市场交投活跃，成交主要集中于 Q2 及 Q4 期限。短端方面，11D 012480846.IB 24 陕延油 SCP002 AAA 在 2.25%成交（估值+8 位置），银行出给基金；46D 012480977.IB 24 中建八局 SCP006 AAA 在 2.25%成交（估值-3 位置），银行出给基金。中长端方面，119D 012383997.IB 23 吉利 SCP008 AAA 在 2.37%成交（估值+3 位置），银行出给基金；140D 012384230.IB 23 杭商贸 SCP003 AAA 在 2.35%成交（估值位置），券商出给基金。长端方面，235D 072310250.IB 23 国泰君安 CP005 AAA 在 2.23%成交（估值-3 位置），基金出给基金；266D 012481127.IB 24 汉江国资 SCP00 AAA 在 2.41%成交（估值-4 位置），基金出给基金。总体而言，收益均小幅震荡下行。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	2.33		2.39		2.43		2.52		2.58	
	AA+	2.45		2.51		2.6		2.65		2.69	
	AA	2.75		2.99		3		3.32		3.35	
	AA-	3.09		3.66		3.78		4.35		4.48	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	2.33	0	2.38	1	2.42	1	2.51	1	2.55	3
	AA+	2.44	1	2.5	1	2.58	2	2.64	1	2.68	1
	AA	2.75	0	2.99	0	3	0	3.32	0	3.35	0
	AA-	3.09	0	3.66	0	3.78	0	4.35	0	4.48	0

中期票据

今日中票交投情绪较为活跃。1-3 年短端中票，22 西安高新 MTN003（AAA，1.43Y）在 2.60%成交，高估值 1bp 成交；24 南昌建投 MTN001（AAA，1.95Y）在 2.69%成交，低估值 2bp 成交；21 沪国际集 MTN001（AAA，2.26Y）成交在 2.51%，高估值 1bp 成交；3 到 5 年期限，24 济南城建 MTN001（AAA，4.93Y）在 2.8%成交，高估值 4bp 成交；24 浙资运营 MTN002（AAA，4.96Y）成交在 2.69%，高估值 1bp 成交。5Y 及以上期限，24 苏交通 MTN001（AAA，9.93Y）成交在 2.80%，高估值 1bp 成交。总体而言，今日中票收益略有上行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.28		2.5		2.59		2.75		None	
	AAA	2.38		2.6		2.7		None		None	
	AA+	2.45		2.72		2.91		None		None	
	AA	2.52		2.83		3.06		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.28	0	2.51	-1	2.61	-2	2.75	0	None	None
	AAA	2.38	0	2.61	-1	2.7	0	None	None	None	None
	AA+	2.45	0	2.73	-1	2.9	1	None	None	None	None
	AA	2.53	-1	2.83	0	3.06	0	None	None	None	None

企业债

今日企业债交投较为活跃，基金，券商，银行，保险和券商资管均有参与。可质押方面，19 洋河 01 AA 成交在 2.32%，基金卖出，基金买入。21 华远 03 AAA 成交在 2.69%，基金卖出，基金买入。23 小米 S1 AAA 成交在 2.40%。城投方面，24 高科 D1 AA+ 成交在 2.56%，银行卖出，理财买入。19 内投 01 AA+ 成交在 2.70%，证券卖出，基金买入。21 武铁 Y1 AAA 成交在 2.53%。长端方面，24 鲲鹏 03 AAA 成交在 2.835%。23 中海 04 AAA 成交在 3.15%

因周一香港复活节假期，美元债市场交投清淡；万达商管签约中东资本，大连新达盟获约 600 亿投资，市场持续关注。

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
9D	042380341.IB	23 电网 CP003	AAA	2.15%
11D	012480846.IB	24 陕延油 SCP002	AAA	2.25%
11D	012480846.IB	24 陕延油 SCP002	AAA	2.25%
11D	012480748.IB	24 华能 SCP001	AAA	2.15%
11D	012480162.IB	24 招商局 SCP002	AAA	2.20%
11D	012480162.IB	24 招商局 SCP002	AAA	2.20%
11D	012480748.IB	24 华能 SCP001	AAA	2.15%
11D	012480162.IB	24 招商局 SCP002	AAA	2.20%
11D	012480162.IB	24 招商局 SCP002	AAA	2.20%
11D	012480846.IB	24 陕延油 SCP002	AAA	2.22%
11D	012480846.IB	24 陕延油 SCP002	AAA	2.22%
11D	012480162.IB	24 招商局 SCP002	AAA	2.15%
15D	072310243.IB	23 国信证券 CP023	AAA	2.06%
18D	072310215.IB	23 平安证券 CP012	AAA	2.08%
23D	012383932.IB	23 杭州钢铁 SCP004	AAA	2.38%
24D	012481078.IB	24 京国资 SCP002	AAA	2.19%
29D	012480380.IB	24 中电路桥 SCP003	AAA	2.28%
39D	012384316.IB	23 海尔金盈 SCP007	AAA	2.67%
43D	012383118.IB	23 津城建 SCP053	AAA	2.49%
44D	012384145.IB	23 越秀资本 SCP006	AAA	2.30%
69D(休 2)	012384259.IB	23 湘高速 SCP010	AAA	2.30%
76D(休 1)	012383498.IB	23 沈阳地铁 SCP002	AAA	2.45%
78D	012383577.IB	23 杭金投 SCP010	AAA	2.34%
80D	012481010.IB	24 万华化学 SCP003(科创票据)	AAA	2.27%
85D	012481082.IB	24 中建三局 SCP005(科创票据)	AAA	2.28%
86D	012481118.IB	24 杭实投 SCP003	AAA	2.30%
88D	012383749.IB	23 武金控 SCP004	AAA	2.32%
107D	012480270.IB	24 广州港 SCP002	AAA	2.30%
109D	012480839.IB	24 徐工集团 SCP006	AAA	2.31%
111D(休 1)	042380403.IB	23 商丘发展 CP002	AA+	2.50%
111D(休 1)	012383902.IB	23 黄石国资 SCP002	AA	2.56%
111D(休 1)	042380403.IB	23 商丘发展 CP002	AA+	2.50%
125D(休 1)	012480212.IB	24 锦江国际 SCP001	AAA	2.35%
125D(休 1)	012480212.IB	24 锦江国际 SCP001	AAA	2.35%
126D	012480761.IB	24 华宝投资 SCP001	AAA	2.35%
140D	012384230.IB	23 杭商贸 SCP003	AAA	2.35%
142D	012480572.IB	24 凤凰传媒 SCP001	AAA	2.30%
144D	012384283.IB	23 浙能源 SCP005	AAA	2.29%
144D	042380478.IB	23 鲁宏桥 CP005	AA+/A-1	2.66%
155D	012384397.IB	23 深业 SCP006	AAA	2.40%
156D	042380510.IB	23 麓山投资 CP001	AA+	2.40%
158D	012480093.IB	24 津渤海 SCP001	AAA	2.60%
162D	012384481.IB	23 深圳特发 SCP004	AAA	2.30%

173D(休 2)	012384577.IB	23 冀中峰峰 SCP001	AA+	2.73%
193D	012480165.IB	24 金坛投资 SCP001	AA	2.55%
214D	072310233.IB	23 天风证券 CP002	AAA	2.36%
235D	072310250.IB	23 国泰君安 CP005	AAA	2.23%
236D(休 2)	012480599.IB	24 甘公投 SCP001	AAA	2.44%
238D	012480612.IB	24 汉江国资 SCP001	AAA	2.43%
239D	012480680.IB	24 甘公投 SCP002	AAA	2.45%
251D(休 1)	042380732.IB	23 宜春发展 CP003	AA+	2.43%
266D	012481120.IB	24 温州能源 SCP002	AA+	2.41%
266D	012481132.IB	24 巨化 SCP002	AA+	2.45%
266D	012481132.IB	24 巨化 SCP002	AA+	2.45%
266D	012481127.IB	24 汉江国资 SCP002	AAA	2.41%
266D	012481127.IB	24 汉江国资 SCP002	AAA	2.41%
266D	012481127.IB	24 汉江国资 SCP002	AAA	2.41%
267D	012481155.IB	24 泉州水务 SCP001	AA+	100
327D(休 2)	042480089.IB	24 宿迁经开 CP001	AA	2.55%
327D(休 2)	042480088.IB	24 津城建 CP001	AAA	2.60%
327D(休 2)	042480088.IB	24 津城建 CP001	AAA	2.60%

1

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
242D	102103124.IB	21 格力 MTN001	AAA	2.39%
266D+NY(休 1)	102282768.IB	22 国开投 MTN002	AAA	2.47%
279D(休 1)	102280005.IB	22 淮南产业 MTN001A	AA/AAA	2.53%
279D(休 1)	102280005.IB	22 淮南产业 MTN001A	AA/AAA	2.53%
280D	102280019.IB	22 长电 MTN001	AAA	2.30%
328D(休 1)	102280320.IB	22 广核电力 MTN001	AAA	2.32%
329D	102000155.IB	20 青岛国信 MTN002	AAA	2.48%
330D	102280371.IB	22 桂投资 MTN002	AAA	2.52%
347D+NY	102380494.IB	23 中电投 MTN003(能源保供特别债)	AAA	2.48%
347D+NY	102380494.IB	23 中电投 MTN003(能源保供特别债)	AAA	2.48%
347D+NY	102380494.IB	23 中电投 MTN003(能源保供特别债)	AAA	2.48%
353D+NY	102380596.IB	23 华电股 MTN003(能源保供特别债)	AAA	2.49%
355D+NY(休 2)	102380618.IB	23 昆山高新 MTN001	AA+	2.58%
360D+NY	102300324.IB	23 中色 MTN001	AAA	2.52%
1.03Y+NY	102380816.IB	23 福瑞能源 MTN001	AAA	2.51%
1.03Y+NY(休 1)	102280761.IB	22 首创集 MTN003	AAA	2.59%
1.07Y	102382907.IB	23 云能投 MTN003	AAA	2.60%
1.07Y(休 2)	102381076.IB	23 红豆 MTN002	AA+/AAA	2.83%
1.11Y(休 2)	102281068.IB	22 亦庄投资 MTN001	AAA	2.43%
1.22Y(休 1)	102001243.IB	20 陕天然气 MTN001	AA+	2.49%
1.31Y+2Y	102281597.IB	22 成都国投 MTN001	AA+	2.56%
1.32Y+NY(休 1)	102281653.IB	22 昆山国创 MTN006	AA+	2.64%
1.36Y	102281783.IB	22 渝医药 MTN002	AA+	2.92%
1.38Y(休 1)	102281814.IB	22 苏州高技 MTN003	AAA	2.54%
1.4Y+NY(休 1)	102281906.IB	22 晋能装备 MTN008(科创票据)	AAA	2.66%
1.43Y	102282034.IB	22 西安高新 MTN003	AAA	2.60%

1.57Y(休 1)	102001989.IB	20 乐山国资 MTN001	AA+	2.60%
1.57Y+3Y	102382911.IB	23 巴洲文旅 MTN001	AA	3.20%
1.59Y	102002069.IB	20 谷财 MTN001	AA	2.59%
1.61Y	102282499.IB	22 光明房产 MTN002	AA+	2.91%
1.71Y	102002300.IB	20 嘉秀发展 MTN001	AA+	2.60%
1.76Y+NY	102300580.IB	23 漳州交运 MTN002	AA+	2.77%
1.95Y+NY	102480813.IB	24 南昌建投 MTN001	AAA	2.69%
1.95Y+2Y	102380485.IB	23 诸暨国资 MTN001	AA+	2.60%
1.96Y	102380562.IB	23 京住总 MTN002	AA/AAA	2.86%
1.96Y	102380562.IB	23 京住总 MTN002	AA/AAA	2.86%
1.98Y	102100538.IB	21 湘江新发 MTN001	AAA	2.56%
2.02Y+2Y	132380024.IB	23 铁建房产 GN001	AAA	2.92%
2.18Y(休 1)	102381317.IB	23 鄂联投 MTN002	AAA	2.74%
2.18Y(休 1)	102381317.IB	23 鄂联投 MTN002	AAA	2.74%
2.18Y(休 1)	102381317.IB	23 鄂联投 MTN002	AAA	2.74%
2.18Y(休 1)	102381317.IB	23 鄂联投 MTN002	AAA	2.74%
2.26Y(休 1)	102101244.IB	21 沪国际集 MTN001	AAA	2.51%
2.26Y(休 1)	102101244.IB	21 沪国际集 MTN001	AAA	2.51%
2.33Y+2Y(休 1)	102101438.IB	21 国兴投资 MTN001	AA+	2.66%
2.45Y+NY(休 1)	102382447.IB	23 晋能电力 MTN010	AAA	2.81%
2.45Y+NY(休 1)	102382447.IB	23 晋能电力 MTN010	AAA	2.81%
2.7Y+NY(休 1)	102383273.IB	23 陕延油 MTN004	AAA	2.71%
2.73Y	102383435.IB	23 泰兴虹桥 MTN001	AA	2.80%
2.78Y	102480098.IB	24 东方新城 MTN001	AA+	2.79%
2.78Y	102480097.IB	24 金坛投资 MTN001	AA	2.89%
2.78Y	102480111.IB	24 晋能煤业 MTN001	AAA	2.80%
2.78Y	102480111.IB	24 晋能煤业 MTN001	AAA	2.80%
2.78Y	102480111.IB	24 晋能煤业 MTN001	AAA	2.80%
2.91Y+NY(休 1)	102480574.IB	24 晋能装备 MTN002	AAA	2.91%
2.91Y(休 1)	102480599.IB	24 巨化 MTN001(可持续挂钩)	AA+	2.72%
2.91Y+NY(休 1)	102480574.IB	24 晋能装备 MTN002	AAA	2.91%
2.93Y(休 2)	102480685.IB	24 鲁钢铁 MTN001	AAA	2.86%
2.97Y	102481134.IB	24 衢州国资 MTN001	AA+	2.69%
2.97Y	102481088.IB	24 酒钢 MTN001(科创票据)	AA+	3.20%
2.98Y+2Y(休 1)	102481178.IB	24 兴蓉环境 MTN001	AAA	2.64%
3.32Y	102281643.IB	22 广州商贸 MTN001	AA+	2.86%
3.79Y(休 1)	102380090.IB	23 华为 MTN001	AAA	2.70%
4.34Y	102381903.IB	23 渝富资本 MTN002(科创票据)	AAA	2.84%
4.82Y	102480304.IB	24 昆山国创 MTN001	AA+	2.91%
4.82Y	102480304.IB	24 昆山国创 MTN001	AA+	2.91%
4.82Y	102480304.IB	24 昆山国创 MTN001	AA+	2.91%
4.91Y	102400632.IB	24 渝两江 MTN001A	AAA	2.78%
4.99Y	102481207.IB	24 鄂联投 MTN002	AAA	3.35%
4.99Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	2.55%
4.99Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	2.55%
14.91Y(休 1)	102480540.IB	24 诚通控股 MTN006B	AAA	3.23%

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
14D	155314.SH	19 洋河 01	AAA	2.32%
14D	155314.SH	19 洋河 01	AAA	2.32%

25D	188047.SH	21 华泰 G3	AAA	2.20%
46D	115352.SH	23 中证 G8	AAA	2.20%
46D	2122024.IB	21 太平石化租赁债 01	AAA	2.29%
56D	188150.SH	21 海通 04	AAA	2.20%
56D+1.99Y	188137.SH	21 启东 G2	AA+	2.44%
67D	188195.SH	21 光证 G2	AAA	2.20%
71D	188247.SH	21 华远 03	AA/AAA	2.69%
74D	148630.SZ	24 广发 D1	AAA/A-1	2.20%
74D	148630.SZ	24 广发 D1	AAA/A-1	2.25%
76D(休 1)	2122038.IB	21 招联消费金融债 03	AAA	2.22%
88D	151620.SH	19 内投 01	AA+	2.70%
103D(休 2)	115639.SH	23 小米 S1	AAA	2.40%
109D	194967.SH	22 市中 05	AA/AA+	3.35%
116D+2Y(休 1)	133048.SZ	21 穗高 02	AA+	2.47%
137D	188583.SH	21 国投 05	AAA	2.30%
144D	155636.SH	19 椒江 01	AA+	2.43%
144D	155636.SH	19 椒江 01	AA+	2.43%
151D+1Y(休 2)	115888.SH	23 中交 K2	AAA	2.30%
153D(休 1)	188689.SH	21 京投 02	AAA	2.32%
161D+2Y	188713.SH	21 保置 01	AAA	2.6655%
166D(休 4)	188753.SH	国电投 12	AAA	2.42%
166D(休 4)	188753.SH	国电投 12	AAA	2.42%
196D	182907.SH	22 贵溪 02	AA	2.90%
199D	188736.SH	21 国君 12	AAA	2.25%
201D(休 2)	196833.SH	21 滨交 02	AA/AA+	2.80%
207D	240048.SH	23 海通 S1	AAA/A-1	2.25%
231D+2Y	185011.SH	21 诚通 19	AAA	2.43%
237D(休 1)	185035.SH	21 东债 02	AAA	2.27%
239D+2Y	197661.SH	21 温岭 03	AA+	2.48%
242D+2Y(休 1)	185033.SH	21 诚通 21	AAA	2.43%
245D+NY(休 1)	149726.SZ	21 武铁 Y1	AAA	2.53%
256D	1980366.IB	19 渝两江双创债 02	AAA	2.43%
265D(休 1)	138737.SH	22 华泰 12	AAA	2.25%
265D(休 1)	138737.SH	22 华泰 12	AAA	2.25%
284D	133742.SZ	24 高科 D1	AA+	2.56%
284D+2Y(休 1)	196164.SH	22 北仑 01	AA+	2.48%
284D+2Y(休 1)	196164.SH	22 北仑 01	AA+	2.48%
319D	185364.SH	22 华泰 G1	AAA	2.32%
319D	196402.SH	22 晋电 02	AAA	2.49%
338D	163206.SH	20 金控 01	AA/AAA	2.55%
340D	138966.SH	23 远东二	AAA	2.86%
344D+2Y	194093.SH	22 华港 01	AAA	2.48%
344D+2Y	194093.SH	22 华港 01	AAA	2.48%
353D+4Y	115072.SH	23 联发 01	AA+/AAA	2.80%
354D+2Y(休 1)	194155.SH	22 北仑 02	AA+	2.49%
357D	149852.SZ	22 申证 05	AAA	2.30%
359D	166383.SH	20 郑建 01	AA+	2.53%
1.03Y	250204.SH	23 路公 01	AA+	2.58%
1.05Y(休 2)	185683.SH	22 东兴 G1	AAA	2.35%
1.07Y+2Y	194471.SH	22 沔控 01	AA+	3.10%
1.08Y	2080123.IB	20 中国诚通债转股债 01	AAA	2.45%
1.17Y(休 1)	185863.SH	22 东海 01	AA+	2.50%

1.17Y(休 1)	185863.SH	22 东海 01	AA+	2.50%
1.22Y+NY	185904.SH	22 交建 Y5	AAA	2.49%
1.27Y+2Y	185967.SH	22 金茂 03	AAA	3.05%
1.28Y(休 2)	137520.SH	22 京发 02	AA/AAA	2.62%
1.46Y+2Y	152575.SH	20 郑发 01	AAA	2.51%
1.46Y+2Y	152575.SH	20 郑发 01	AAA	2.51%
1.61Y+NY(休 2)	240216.SH	23 住总 Y1	AAA	2.65%
1.7Y(休 1)	175542.SH	20 沪投 01	AA/AAA	2.70%
1.73Y+NY	138773.SH	华电 YK02	AAA	2.53%
1.8Y	149349.SZ	21 华控 01	AAA	2.88%
1.8Y	138858.SH	23 东海 01	AA+	2.67%
1.85Y+NY(休 2)	240575.SH	24 恒信 Y1	AAA	3.10%
1.87Y	138885.SH	23 中航 G1	AAA	2.53%
1.92Y+2Y(休 2)	240632.SH	24 中金 G1	AAA	2.44%
1.94Y	149399.SZ	21 珠华 G1	AAA	2.86%
1.94Y	149399.SZ	21 珠华 G1	AAA	2.86%
1.96Y	115087.SH	23 招证 C4	AAA	2.54%
1.97Y(休 2)	185539.SH	G22 临债 1	AAA	2.56%
1.98Y	250457.SH	23 生态 01	AA	2.80%
2Y	175921.SH	21 宁开控	AA+	2.63%
2.11Y(休 1)	127352.SH	16 恒投 01	AAA	2.51%
2.15Y	188126.SH	G21 张江 1	AAA	2.55%
2.25Y	251435.SH	23 江国 01	AA+	2.80%
2.28Y+3Y	148372.SZ	23 国际 P1	AAA	2.58%
2.38Y+NY(休 1)	092100008.IB	21 中国信达债 01	AAA	2.99%
2.39Y	143258.SH	17 洋河 02	AAA	2.60%
2.44Y+2Y	133649.SZ	23 堰控 03	AA+	3.01%
2.44Y+2Y	133649.SZ	23 堰控 03	AA+	3.01%
2.47Y	240007.SH	23 国君 10	AAA	2.50%
2.71Y+NY	185147.SH	21 平证 Y1	AAA	2.82%
2.71Y+NY	185147.SH	21 平证 Y1	AAA	2.82%
2.71Y+NY	185147.SH	21 平证 Y1	AAA	2.82%
2.71Y+NY	185147.SH	21 平证 Y1	AAA	2.82%
2.83Y+NY	240552.SH	鲁高 KY04	AAA	2.74%
2.83Y+NY	240552.SH	鲁高 KY04	AAA	2.74%
2.84Y	253807.SH	24 国康 K1	AAA	3.64%
2.84Y	253827.SH	24 常滨 01	AA+	2.86%
2.84Y	253827.SH	24 常滨 01	AA+	2.86%
2.86Y+2Y	253887.SH	24 历控 01	AA+	2.93%
2.91Y(休 1)	253985.SH	24 齐财 01	AA/AA+	3.46%
2.91Y(休 1)	253985.SH	24 齐财 01	AA/AA+	3.46%
2.92Y	2422002.IB	24 永赢金租债 01	AAA	2.59%
2.93Y+2Y	254046.SH	24 武侯 02	AA+	2.75%
2.97Y(休 2)	2422012.IB	24 昆仑金租债 01	AAA	2.64%
2.97Y(休 2)	2422012.IB	24 昆仑金租债 01	AAA	2.64%
2.97Y	254130.SH	24 滨湖 01	AA+	2.75%
2.98Y	254258.SH	24 吴开 01	AA+	2.75%
9.88Y	240616.SH	24 中证 G3	AAA	2.75%
107D	031900562.IB	19 九联投资 PPN002	AA+	2.52%
151D+2Y(休 1)	032380814.IB	23 黄石城发 PPN004	AA+	2.65%
170D+1.99Y	032101026.IB	21 荣成经开 PPN002	AA	2.76%
1.21Y	032380554.IB	23 青岛海控 PPN001	AAA	2.66%

1.34Y(休 1)	032300446.IB	23 洛阳城乡 PPN006	AA+	2.73%
1.34Y(休 1)	032300446.IB	23 洛阳城乡 PPN006	AA+	2.73%
1.68Y	032001015.IB	20 泰山投资 PPN001	AA+	2.72%
1.8Y+1Y(休 1)	032480050.IB	24 沛县城投 PPN001	AA	2.82%
1.89Y(休 3)	032300322.IB	23 先行控股 PPN001	AA+	2.74%
1.98Y+1Y	032400669.IB	24 胶州湾 PPN001A	AA+	2.88%
2.07Y+2Y	032300375.IB	23 重庆临空 PPN001	AA+	2.80%
2.1Y	032380454.IB	23 江东控股 PPN001	AA+	2.72%
2.1Y	032380454.IB	23 江东控股 PPN001	AA+	2.72%
2.19Y+2Y	032380523.IB	23 赣州城投 PPN002	AA+	2.78%
2.41Y+3Y	032300475.IB	23 涪陵国资 PPN002	AA+	2.77%
2.47Y(休 1)	032380924.IB	23 常德城投 PPN008	AA+	2.80%
7D	2128013.IB	21 交通银行小微债	AAA	2.05%
7D	2128013.IB	21 交通银行小微债	AAA	2.05%
7D	2128013.IB	21 交通银行小微债	AAA	2.05%
7D	2128013.IB	21 交通银行小微债	AAA	2.05%
8D	2120025.IB	21 杭州银行小微债 01	AAA	2.06%
8D	2120025.IB	21 杭州银行小微债 01	AAA	2.10%
25D+5Y	1928011.IB	19 工商银行二级 03	AAA	2.20%
28D+5Y(休 1)	1928010.IB	19 平安银行二级	AAA	2.30%
28D+5Y(休 1)	1928010.IB	19 平安银行二级	AAA	2.30%
28D+5Y(休 1)	1928010.IB	19 平安银行二级	AAA	2.30%
59D+5Y	1920039.IB	19 杭州银行二级	AAA	2.29%
59D+5Y	1920039.IB	19 杭州银行二级	AAA	2.29%
86D+NY	1928014.IB	19 华夏银行永续债	AAA	2.37%
86D+NY	1928014.IB	19 华夏银行永续债	AAA	2.37%
86D+NY	1928014.IB	19 华夏银行永续债	AAA	2.37%
86D+NY	1928014.IB	19 华夏银行永续债	AAA	2.37%
102D+5Y	1920046.IB	19 宁波银行二级	AAA	2.33%
102D+5Y	1920046.IB	19 宁波银行二级	AAA	2.335%
102D+5Y	1920046.IB	19 宁波银行二级	AAA	2.33%
102D+5Y	1920046.IB	19 宁波银行二级	AAA	2.33%
118D(休 1)	2128024.IB	21 中国银行 02	AAA	2.20%
118D(休 1)	2128024.IB	21 中国银行 02	AAA	2.20%
118D(休 1)	2128024.IB	21 中国银行 02	AAA	2.19%
120D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.38%
120D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.38%
120D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.38%
120D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.38%
120D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.38%
120D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.38%
137D+5Y	1928019.IB	19 交通银行二级 01	AAA	2.30%
143D+5Y	1920049.IB	19 成都银行二级	AAA	2.37%
157D+NY	1928023.IB	19 农业银行永续债 02	AAA	2.38%
172D+NY	1928025.IB	19 交通银行永续债	AAA	2.38%
172D+NY	1928025.IB	19 交通银行永续债	AAA	2.40%
172D+NY	1928025.IB	19 交通银行永续债	AAA	2.40%
223D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.22%
223D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.22%
223D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.22%
223D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.22%
229D(休 2)	2128041.IB	21 广发银行小微债	AAA	2.22%

235D+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA	2.34%
235D+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA	2.34%
248D+5Y	1920079.IB	19 龙江银行二级 02	AA+/AA	3.30%
249D	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	2.21%
249D	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	2.21%
253D	2128048.IB	21 民生银行 02	AAA	2.27%
266D	2120116.IB	21 南京银行 01	AAA	2.25%
266D	2120116.IB	21 南京银行 01	AAA	2.25%
330D+NY	2028003.IB	20 平安银行永续债 01	AAA	2.475%
334D(休 2)	2228015.IB	22 浦发银行 03	AAA	2.28%
334D(休 2)	2228015.IB	22 浦发银行 03	AAA	2.28%
347D	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	2.25%
347D	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	2.25%
351D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.395%
351D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.395%
1.05Y+5Y(休 2)	2020022.IB	20 南京银行二级 01	AAA	2.405%
1.1Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.35%
1.1Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.36%
1.1Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.36%
1.1Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.36%
1.1Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.37%
1.1Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.37%
1.1Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.38%
1.14Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.355%
1.14Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.355%
1.21Y	2228037.IB	22 交通银行小微债 01	AAA	2.26%
1.34Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.40%
1.34Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.40%
1.34Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.40%
1.34Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.40%
1.36Y+5Y(休 2)	2020044.IB	20 宁波银行二级	AAA	2.43%
1.36Y+5Y(休 2)	2020044.IB	20 宁波银行二级	AAA	2.43%
1.47Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.385%
1.47Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.385%
1.47Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.40%
1.47Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.40%
1.48Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.39%
1.48Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.39%
1.48Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.39%
1.48Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.39%
1.48Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.42%
1.48Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.42%
1.48Y+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.43%
1.54Y+NY	2028042.IB	20 兴业银行永续债	AAA	2.48%
1.59Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.45%
1.61Y	2220076.IB	22 北京银行小微债 03	AAA	2.34%
1.61Y	2228057.IB	22 浦发银行 04	AAA	2.32%
1.61Y	2228057.IB	22 浦发银行 04	AAA	2.32%
1.65Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.49%
1.65Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.49%
1.65Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.49%
1.66Y+NY	2021035.IB	20 江南农商永续债 02	AAA/AA+	2.78%

1.7Y+NY(休 1)	2028053.IB	20 中国银行永续债 03	AAA	2.47%
1.75Y+5Y(休 1)	200219.IB	20 国开 19		2.47%
1.75Y+5Y(休 1)	200219.IB	20 国开 19		2.47%
2.05Y+NY	2128016.IB	21 民生银行永续债 01	AAA	2.77%
2.16Y(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	2.395%
2.19Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.53%
2.19Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.53%
2.19Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.515%
2.19Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.515%
2.19Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.515%
2.3Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.375%
2.3Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.375%
2.3Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.38%
2.36Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.50%
2.4Y	2320040.IB	23 北京银行绿色债	AAA	2.42%
2.49Y(休 2)	212380021.IB	23 交行债 02	AAA	2.395%
2.49Y(休 2)	212380021.IB	23 交行债 02	AAA	2.395%
2.57Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	2.53%
2.64Y(休 2)	2328024.IB	23 中国银行三农债 01	AAA	2.395%
2.7Y+5Y(休 1)	2128049.IB	21 建设银行二级 05	AAA	2.54%
2.71Y+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	2.52%
2.71Y+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	2.52%
2.8Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	2.58%
2.81Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	2.53%
2.81Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	2.53%
2.81Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	2.53%
2.81Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	2.53%
2.82Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.53%
2.82Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.53%
2.82Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.525%
2.82Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.53%
2.82Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.54%
2.82Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.54%
2.85Y(休 5)	2428001.IB	24 平安银行小微债 01	AAA	2.45%
2.85Y(休 5)	2428001.IB	24 平安银行小微债 01	AAA	2.45%
2.93Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.535%
2.93Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.535%
2.93Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.535%
2.93Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.55%
2.93Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.55%
2.98Y	2428003.IB	24 招商银行三农债	AAA	2.44%
2.98Y	2428003.IB	24 招商银行三农债	AAA	2.44%
3.04Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	2.54%
3.04Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	2.54%
3.04Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	2.535%
3.07Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	AAA	2.615%
3.21Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.55%
3.21Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.55%
3.21Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.57%
3.22Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	2.56%
3.39Y+5Y(休 1)	092280065.IB	22 工行二级资本债 03A	AAA	2.58%
3.39Y+5Y(休 1)	092280065.IB	22 工行二级资本债 03A	AAA	2.58%

3.39Y+5Y(休 1)	092280065.IB	22 工行二级资本债 03A	AAA	2.56%
3.39Y+5Y(休 1)	092280065.IB	22 工行二级资本债 03A	AAA	2.565%
3.48Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.595%
3.48Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.595%
3.57Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	2.59%
3.61Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.595%
3.62Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.59%
3.62Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.59%
3.7Y+5Y(休 1)	232280003.IB	22 成都银行二级资本债 01	AAA	2.77%
4.49Y+NY	242380021.IB	23 建行永续债 02	AAA	2.70%
4.49Y+NY	242380021.IB	23 建行永续债 02	AAA	2.70%
4.49Y+NY	242380021.IB	23 建行永续债 02	AAA	2.70%
4.49Y+NY	242380021.IB	23 建行永续债 02	AAA	2.70%
4.55Y+NY	242380019.IB	23 邮储永续债 01	AAA	2.71%
4.58Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA	2.64%
4.58Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA	2.64%
4.63Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	2.635%
4.67Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.725%
4.67Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.73%
4.67Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.73%
4.67Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.735%
4.85Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.635%
4.95Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.7275%
4.95Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.7275%
4.96Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.73%
4.96Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.73%
4.96Y	2420012.IB	24 浙商银行小微债 02	AAA	2.54%
4.96Y	2420012.IB	24 浙商银行小微债 02	AAA	2.54%