

收盘日评 银行间债券市场

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2026-05-27】

国债

今日央行开展 1776 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 500 亿，逆回购口径资金净投放 1276 亿。

国债方面 1.75Y 250005 1.2025-1.21; 3.67Y 250003 1.335-1.35; 5.83Y 250007 1.495-1.51; 9.25Y 250016 1.725-1.74; 29.25Y 2500006 2.245-2.256。

	1y	3y	5y	7y	10y	30y
昨日国债(%)	1.1200	1.2150	1.4350	1.5350	1.7425	2.2520
今日国债(%)	1.1200	1.2050	1.4200	1.5225	1.7250	2.2470
变动(%)	0.0000	-0.0100	-0.0150	-0.0125	-0.0175	-0.0050

金融债

金融债方面 237D 260401 1.3125-1.35; 2.74Y 240203 1.415-1.425; 5.65Y 220205 1.5975-1.61; 9.07Y 250215 1.7675-1.795。

	1y	3y	5y	7y	10y
昨日非国开金融债(%)	1.2800	1.4350	1.5250	1.6950	1.8000
今日非国开金融债(%)	1.2750	1.4200	1.5000	1.6775	1.7800
变动(%)	-0.0050	-0.0150	-0.0250	-0.0175	-0.0200
昨日国开债(%)	1.3450	1.4550	1.5300	1.6650	1.7950
今日国开债(%)	1.3400	1.4400	1.5110	1.6500	1.7700
变动(%)	-0.0050	-0.0150	-0.0190	-0.0150	-0.0250

银行债

5y 大行二级全天交易十分活跃，买盘情绪火热，收益率持续震荡下行。非免税券昨收 1.8775 (-0.64)，今开 1.87 (-1.39)。日内最高 1.875 (-0.89)，最低 1.865 (-1.89)，震荡区间 1bp，今收 1.865 (-1.89)，尾盘对峙为 1.865/1.8625。盘中与同期限大行永续相差约 2.5bp，券商基金为主要参与方；

25 农行二级资本债 01A(BC) 昨收 1.775 (+0.15)，今开 1.76(-1.35)，日内最高 1.76 (-1.35)，最低 1.76 (-1.35)，今收 1.76 (-1.35)，尾盘对峙为 1.755/1.72，市场成交较为活跃；

25 农行二级资本债 02B(BC) 昨收 2.1175 (-0.10)，今开 2.1(-1.85)，最高 2.105(-1.35)，最低 2.095(-2.35)，今收 2.095(-2.35)，尾盘对峙为 2.0975/2.095。

4-5 股份制二永今日收益下行。4.99Y+NY 26 民生银行永续债 01 成交在 2.06 (-2.17) 到 2.0725 (-0.92)，震荡区间 1.25bp。4-5 股份制二永情绪活跃，基金，券商有参与。

今日 1-3y 大行二级今日成交收益率小幅震荡下行，较昨日收盘价下行近 0.5bp；1y 大行今开 1.485/1.48，成交在 1.48 (-0.40) 和 1.475 (-0.90)，尾盘收在 1.475/1.47。2y 大行今开 1.545/1.54，成交在 1.545 (-0.68)，尾盘收在 1.545/1.54。今日 1-3y 大行二级交易情绪较为平淡，买卖盘力量均衡，基金、理财、券商及其资管、银行均有参与。

商金方面，1-3y 大行主要成在 (-1) 到估值 (+0)。1y 24 交行债 01 成在 1.437 (+0)。股份制主要成在 (-1.5) 到 (-0.5)。1.73y 25 浙商银行债 01A 成在 1.505 (-0.78)。城商行今日主要成在 (-3) 到估值 (+0.5)。科创今日成交主要成在 (-2.5) 到估值 (+0)。1.97y 25 农业银行科创债成在 1.47 (-1.55) 到 1.475 (-1.05)。收益率全天走低，尾盘后继续走低。基金、理财、券商资管/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一般，成交主要集中于 2026Q3 期限。短端方面，30D 012680859 26 伊利实业 SCP009 AAA tkn 成交在 1.4% (+0.69)，基金出给基金；86D 012680840 26 中交投 SCP001 AAA 成交在 1.43% (-1.00)，基金出给基金。中长端方面，116D(银休 1) 012583147 25 皖投集 SCP001 AAA 成交在 1.45 (-0.58)，基金出给基金。长端方面，212D 012681274 26 中建二局 SCP003 AAA 成交在 1.44% (+0.03)，银行出给银行。总体而言，短端、中长端和长端收益日内均变化不大。

中期票据

今日中票收益早盘在估值-1左右，尾盘成在估值-1附近。汇金、电网今日成交普通。3.18y 汇金今日在 1.63% (-1.37) 成交，9.83Y 电网今日在 2.1075% (-1.25) 成交。

1-3Y，好名字整体成交在估值-3 到估值+1，1.45Y 22 京能洁能 MTN002 成在 1.57% (-1.16)，2.87Y 26 江西交投 MTN004 成在 1.665% (-0.01)，2.96Y 2 26 深圳资本 MTN001 成在 1.71% (-0.22)。成交收益率集中在 1.60%-1.90%，银行出给基金。

3-5Y，好名字整体成交在估值-2 到估值+0，4.08Y 25 兵器 MTN006 成在 1.735% (-0.59)，4.9Y 26 泉州发展 MTN002 成在 1.90% (+0.26)，4.75Y 24 皖交控 MTN002 成在 1.78% (-0.75)，收益率集中在 1.70%-1.85%，券商出给基金、资管。

5Y+，7.97Y 24 苏交通 MTN006 成在 2.05% (+0.04)；9.81Y 26 国盛 MTN001(科创债)成在 2.17% (-0.99)，成交收益率主要集中在 1.85%-2.20%。永续中票集中在 1-3Y 附近的好名字，成交收益率大概在估值-4 到估值+0，基金出给基金。

企业债

交易所信用债全天交投一般，基金，券商，保险，理财，银行均有参与，基金理财为主。全天收益震荡下行。

1年内，券商债成交在估值到估值-2 到估值+1 之间 (356D+1Y 26 中金 G5 100)，基金理财双边参与；非券商债多成交在 1.43-1.55，(348D 24 张江 01 1.51)，基金理财保险买，基金保险卖；年内科创债寥寥。

1-3年，今日券商债成交活跃，成交多在估值-1 附近 (2.12Y 25 中金 G2(免) 1.605)，基金保险买，基金理财卖；非券商债成交尚可，多成交在估值-2 到估值之间 (2.22Y 21 长发 05 1.60)，基金保险券商买，银行基金卖。科创债成交尚可 (2.91Y 26 电投 K4 1.64)。

3-5年，券商债今日成交寥寥；非券商债方面今日成交尚可，成交多在估值-2.5 到估值+0.0 (4.77Y 26 蓉金 01 1.83)，基金券商银行双边参与，理财买，券商资管卖；科创方面今日成交尚可，成交在估值-2.0 到估值+0.0 (3.41Y 24 广新 K1 1.71)，基金券商双边参与，券商资管买，银行卖。

5Y+，券商债成交寥寥，成交多在估值-0.5 到估值-1 之间 (8.96Y 25GTHK2 2.07)；非券商债成交较活跃，成交多在估值-0.5 到估值-1 之间 (6.09Y 22 国管 01 1.88)，基金理财买，基金券商卖；科创方面成交亦较活跃，成交多在估值-1 附近 (9.46Y 25 国新 K2 2.11)，基金保险券商买，银行基金卖。

美元债

周三市场整体平稳。城投板块，高评级点心债有少量获利了结卖盘出现，买盘需求依旧强烈，性价比美元城投亦有买盘需求。地产板块，普洛斯上涨 0.1-0.25pt。

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	012500468.IB	25 长寿开投 SCP005	AA+	1.46
13D	072510096.IB	25 东财证券 CP004	AAA	1.36
30D	012680685.IB	26 南通城建 SCP002	AAA	1.4
30D	012680859.IB	26 伊利实业 SCP009	AAA	1.4
64D	072610001.IB	26 中信建投 CP001	AAA	1.4
64D	072610001.IB	26 中信建投 CP001	AAA	1.4
86D	012680840.IB	26 中交投 SCP001	AAA	1.43
86D	012680840.IB	26 中交投 SCP001	AAA	1.43
93D	012680015.IB	26 中建一局 SCP001(科创债)	AAA	1.43

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(%)
48D	102101292.IB	21 渝高速 MTN001	AAA	1.44
48D	102101292.IB	21 渝高速 MTN001	AAA	1.44
48D	102381671.IB	23 蜀道投资 MTN006	AAA	1.445
50D	102101310.IB	21 南京国投 MTN001	AAA	1.45
50D	102101310.IB	21 南京国投 MTN001	AAA	1.45
55D+NY	102381763.IB	23 江宁经开 MTN002	AAA	1.54 行权
61D	102381849.IB	23 义乌国资 MTN002	AAA	1.45
61D	102381849.IB	23 义乌国资 MTN002	AAA	1.45
61D	102381849.IB	23 义乌国资 MTN002	AAA	1.45
68D	102101444.IB	21 知识城 MTN005	AAA	1.44
68D	102381918.IB	23 豫交投 MTN006	AAA	1.43
79D+NY	132380055.IB	23 中节能 GN002	AAA	1.51 行权
84D	102101598.IB	21 蓉城轨交 MTN003	AAA	1.42
90D	102382226.IB	23 石交投集 MTN002	AAA	1.47
95D(休 1)	102101737.IB	21 武侯资本 MTN002	AA+	1.49
118D	102101920.IB	21 南昌轨交 MTN001	AAA	1.44
118D	102101920.IB	21 南昌轨交 MTN001	AAA	1.44
120D	102101948.IB	21 华润 MTN001	AAA	1.41
139D+NY	102382684.IB	23 长沙水业 MTN004	AA+	1.54 行权
152D	102300522.IB	23 三明城投 MTN001	AA	1.53

175D	102484951.IB	24 华电股 MTN008	AAA	1.41
182D	102103087.IB	21 首开 MTN005	AAA	2.3
182D	102103087.IB	21 首开 MTN005	AAA	2.3
205D+2Y	102383373.IB	23 华远陆港 MTN004	AAA	1.48 行权
206D(休 2)	102383371.IB	23 联发集 MTN004	AA+	1.68
209D	102383420.IB	23 河南投资 MTN003	AAA	1.43
215D+NY(休 1)	102383447.IB	23 福建漳州 MTN007B	AAA	1.58 行权
230D	102480122.IB	24 乐清国投 MTN001	AA+	1.49
290D(休 2)	102480832.IB	24 粤珠江 MTN003	AAA	1.73
306D	102481303.IB	24 景德镇陶 MTN002	AA+	1.53
326D(休 1)	102481582.IB	24 津渤海 MTN002	AAA	1.57
334D	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA	1.44
334D	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA	1.44
334D	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA	1.44
364D	102585030.IB	25 苏国信 MTN008	AAA	1.46
364D	102585030.IB	25 苏国信 MTN008	AAA	1.46
1.01Y+2Y	102482102.IB	24 冀中峰峰 MTN002B	AA+	1.80 行权
1.01Y+2Y	102482102.IB	24 冀中峰峰 MTN002B	AA+	1.80 行权
1.04Y	102482228.IB	24 冀中能源 MTN010B(科创票 据)	AAA	1.8
1.04Y	102482228.IB	24 冀中能源 MTN010B(科创票 据)	AAA	1.8
1.12Y+NY(休 2)	102582814.IB	25 拉萨城投 MTN002	AA+	1.7 行权
1.19Y+4Y	102501511.IB	25 首开 MTN005A	AAA	3.13 行权
1.22Y	102281823.IB	22 粤交投 MTN002	AAA	1.505
1.22Y	102281823.IB	22 粤交投 MTN002	AAA	1.505
1.25Y	102483819.IB	24 国家能源 MTN001	AAA	1.51
1.25Y(休 2)	102483857.IB	24 电网 MTN001	AAA	1.5
1.28Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	1.5025
1.28Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	1.5025
1.28Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	1.5025
1.29Y(休 2)	102484031.IB	24 河钢集 MTN015	AAA	1.58
1.31Y(休 2)	102400953.IB	24 国电 MTN003	AAA	1.52
1.33Y(休 1)	102484285.IB	24 南航集 MTN002	AAA	1.54
1.33Y(休 1)	102484285.IB	24 南航集 MTN002	AAA	1.54
1.33Y(休 1)	102484285.IB	24 南航集 MTN002	AAA	1.54
1.38Y	102584199.IB	25 汇金 MTN006	AAA	1.51
1.41Y(休 1)	102484606.IB	24 光大集团 MTN005	AAA	1.545
1.43Y(休 2)	102484738.IB	24 鄂尔国投 MTN001	AAA	1.7
1.45Y+NY(休 1)	102282479.IB	22 蜀道投资 MTN012B	AAA	1.6 行权
1.45Y+NY(休 1)	102282479.IB	22 蜀道投资 MTN012B	AAA	1.6 行权
1.48Y(休 2)	102485016.IB	24 华能 MTN009	AAA	1.54
1.51Y(休 1)	102585019.IB	25 汇金 MTN007	AAA	1.53
1.62Y(休 1)	102580135.IB	25 邯郸交投 MTN001A	AA+	1.67
1.69Y	102680411.IB	26 复星医药 MTN001(科创债)	AAA	2.18
1.72Y	102580552.IB	25 深燃气 MTN002(科创票据)	AAA	1.56
1.78Y+2Y	102501223.IB	25 首开 MTN002B	AAA	3.60 行权
1.84Y+NY	102581419.IB	25 西安高新 MTN007	AAA	2.03 行权
2.02Y+2Y	102582236.IB	25 青岛海控 MTN003	AAA	1.74 行权
2.14Y	102580336.IB	25 电网 MTN001	AAA	1.5975
2.14Y	102580354.IB	25 电网 MTN002	AAA	1.5975
2.17Y(休 2)	102583121.IB	25 浙交投 MTN004	AAA	1.59
2.32Y+2Y	102583967.IB	25 香格里拉 MTN003(BC)	AAA	1.77 行权
2.7Y	102480480.IB	24 建发集 MTN001	AAA	2.03
2.7Y	102680501.IB	26 振兴基金 MTN001	AAA	100.00 净价

2.79Y(休 1)	102480805.IB	24 闽能源 MTN001	AAA	1.645
2.79Y(休 1)	102680752.IB	26 石家国投 MTN001	AAA	1.7
2.79Y+NY	102680788.IB	26 鲁高速 MTN004	AAA	1.72 行权
2.83Y(休 1)	102681070.IB	26 通汇投资 MTN001	AA+	1.94
2.87Y+2Y	102601970.IB	26 知识城 MTN004	AAA	1.85 行权
2.89Y	102601987.IB	26 京能电力 MTN001	AAA	1.67
2.9Y	102481612.IB	24 鄂交投 MTN001	AAA	1.66
2.9Y	102481612.IB	24 鄂交投 MTN001	AAA	1.66
2.9Y(休 1)	102681567.IB	26 银川通联 MTN001	AA+	2.08
2.91Y	102681635.IB	26 晋路桥 MTN001	AAA	1.93
2.91Y	102681635.IB	26 晋路桥 MTN001	AAA	1.93
2.92Y	102681682.IB	26 鲁钢铁 MTN003	AAA	1.9
2.92Y	102681682.IB	26 鲁钢铁 MTN003	AAA	1.9
2.93Y+NY(休 3)	102681766.IB	26 石交投集 MTN002A	AAA	1.83 行权
2.98Y(休 1)	102681850.IB	26 深圳高速 MTN001	AAA	1.66
2.99Y	102681874.IB	26 昆山创业 MTN003	AAA	1.7
2.99Y	102681874.IB	26 昆山创业 MTN003	AAA	1.7
3Y(休 2)	102681914.IB	26 南京医药 MTN001	AA+	1.82
3.03Y	102482210.IB	24 信阳建投 MTN004	AAA	2.01
3.07Y	102482391.IB	24 株洲云龙 MTN001	AA	2.08
3.1Y	102482821.IB	24 招商公路 MTN001	AAA	1.68
3.11Y	102482863.IB	24 嘉兴高新 MTN001	AA+	1.77
3.14Y	102483085.IB	24 镇江交通 MTN002	AA+	1.81
3.64Y	102580252.IB	25 上海华谊 MTN001	AAA	1.75
3.76Y	102580846.IB	25 渝富 MTN001	AAA	1.77
3.79Y	102581058.IB	25 中电投 MTN002B	AAA	1.71
3.95Y	102582042.IB	25 淮北建投 MTN004	AA+	2.06
4.2Y	102583248.IB	25 胶州湾 MTN002B	AA+	2.8
4.21Y	102583432.IB	25 国家能源 MTN003	AAA	1.73
4.48Y	102584957.IB	25 南电 MTN018	AAA	1.72
4.48Y	102584957.IB	25 南电 MTN018	AAA	1.72
4.66Y	102601814.IB	26 鲁信 MTN001	AAA	2
4.7Y	102680470.IB	26 平顶发展 MTN001	AA+	2.25
4.7Y	102680514.IB	26 沪港务 MTN004	AAA	1.78
4.7Y	102680514.IB	26 沪港务 MTN004	AAA	1.78
4.81Y	102680940.IB	26 广州城投 MTN002	AAA	1.84
4.85Y	102681205.IB	26 武汉国投 MTN001(并购)	AAA	1.91
4.87Y	102681299.IB	26 福建能化 MTN001	AAA	1.85
4.92Y	102681702.IB	26 丰台国资 MTN001	AAA	1.88
4.92Y	102681702.IB	26 丰台国资 MTN001	AAA	1.88
4.92Y	102681702.IB	26 丰台国资 MTN001	AAA	1.88
4.92Y	102681702.IB	26 丰台国资 MTN001	AAA	1.88
4.92Y	102681702.IB	26 丰台国资 MTN001	AAA	1.88
4.92Y	102681702.IB	26 丰台国资 MTN001	AAA	1.88
4.92Y	102681702.IB	26 丰台国资 MTN001	AAA	1.88
4.92Y	102681702.IB	26 丰台国资 MTN001	AAA	1.88
7.87Y	102481375.IB	24 川能投 MTN004A	AAA	2.125
7.87Y	102481375.IB	24 川能投 MTN004A	AAA	2.13
7.88Y	102481454.IB	24 渝高速 MTN003	AAA	2.13
7.97Y	102481949.IB	24 苏交通 MTN006	AAA	2.05
8.52Y(休 2)	102485205.IB	24 粤交投 MTN006	AAA	2.13
9.81Y	102680906.IB	26 国盛 MTN001(科创债)	AAA	2.17
9.81Y	102680906.IB	26 国盛 MTN001(科创债)	AAA	2.17
9.83Y	102681143.IB	26 电网 MTN008	AAA	2.1075
9.83Y	102681143.IB	26 电网 MTN008	AAA	2.1075
9.92Y	102681714.IB	26 南昌建投 MTN005	AAA	2.4

20Y(休 2)	102681905.IB	26 电网 MTN014	AAA	2.4
20Y(休 2)	102681905.IB	26 电网 MTN014	AAA	2.41
20Y(休 2)	102681905.IB	26 电网 MTN014	AAA	2.41
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.4
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.4
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.4075
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.4075
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.4075
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.4075
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.4075
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.4075
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.41
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.41
20Y(休 2)	102681907.IB	26 电网 MTN015	AAA	2.41
20Y(休 2)	102681915.IB	26 电网 MTN013	AAA	2.4
20Y(休 2)	102681915.IB	26 电网 MTN013	AAA	2.4075
20Y(休 2)	102681915.IB	26 电网 MTN013	AAA	2.41
20Y(休 2)	102681915.IB	26 电网 MTN013	AAA	2.41
20Y(休 2)	102681915.IB	26 电网 MTN013	AAA	2.41

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（%）
41D	188356.SH	21 产发 01	AAA	1.44
51D	115642.SH	23 银河 G1	AAA	1.39
63D	244641.SH	26 中证 S1	AAA	1.405
63D	244641.SH	26 中证 S1	AAA	1.405
76D+NY	115784.SH	铁工 YK05	AAA	1.46 行权
76D+NY	115784.SH	铁工 YK05	AAA	1.46 行权
76D	148422.SZ	23 徐工 01	AAA	1.44
76D	148422.SZ	23 徐工 01	AAA	1.44
99D	149618.SZ	21 盐港 02	AAA	1.44
112D	149634.SZ	21 广发 11	AAA	1.375
144D(休 1)	242591.SH	25 中金 K1	AAA	1.45
144D(休 1)	242591.SH	25 中金 K1	AAA	1.45
159D+NY(休 2)	240077.SH	23 市政 Y1	AA+	1.57 行权
166D+21Y(休 2)	240154.SH	23 京保 01	AAA	1.47 行权
177D+2Y	240312.SH	23 财金 03	AAA	1.45 行权
180D+2Y	240305.SH	23 江城 01	AAA	1.48 行权
210D	032191486.IB	21 十堰国投 PPN004	AA	1.55
233D	032480045.IB	24 龙城发展 PPN001	AAA	1.5
233D	032480045.IB	24 龙城发展 PPN001	AAA	1.5
233D	243920.SH	25GTHT13	AAA	1.43
233D	243920.SH	25GTHT13	AAA	1.43
237D	148583.SZ	24 广发 01	AAA	1.43
255D(休 9)	253872.SH	24 漳交 01	AAA	1.5
278D	254004.SH	24 兴化 01	AA	1.56
291D+NY(休 1)	185445.SH	22 光证 Y2	AAA	1.47 行权
291D+NY(休 1)	185445.SH	22 光证 Y2	AAA	1.47 行权
299D	032480281.IB	24 江北建投 PPN001	AAA	1.51
1.05Y+2Y	148775.SZ	24 珠华 01	AAA	2.00 行权
1.3Y	255799.SH	24 滕资 01	AA+	1.8
1.48Y	2080365.IB	20 胶州专项债 01	AA+	2.215
1.48Y	2080365.IB	20 胶州专项债 01	AA+	2.215
1.54Y+2Y(休 1)	032481590.IB	24 泉汇产发 PPN003	AA+	1.90 行权
1.75Y(休 2)	242388.SH	25 大众 01	AAA	1.66

1.79Y(休 2)	244827.SH	26 中证 G5	AAA	1.57
1.79Y(休 2)	244827.SH	26 中证 G5	AAA	1.57
1.81Y	257791.SH	25 三亚 01	AAA	1.8
1.82Y	242606.SH	25 津投 01	AAA	1.66
1.83Y	524194.SZ	25 申宏 02	AAA	1.585
1.86Y+2Y(休 2)	148234.SZ	23 建房 F2	AAA	2.15 行权
1.86Y+2Y(休 2)	148234.SZ	23 建房 F2	AAA	2.15 行权
1.86Y+2Y(休 2)	148234.SZ	23 建房 F2	AAA	2.15 行权
1.86Y+2Y(休 2)	148234.SZ	23 建房 F2	AAA	2.15 行权
1.87Y(休 1)	520034.SZ	26 国证 08	AAA	1.62
2.06Y+NY	258987.SH	25 北建 Y1	AA+	1.91 行权
2.12Y+10Y(休 2)	148358.SZ	23 粤财 K2	AAA	1.59 行权
2.12Y	242651.SH	25 中金 G2	AAA	1.605
2.19Y(休 1)	243498.SH	25 宣城 01	AA+	1.66
2.19Y(休 1)	243498.SH	25 宣城 01	AA+	1.66
2.2Y+2Y	259624.SH	25 恒业 05	AA+	2.06 行权
2.2Y+2Y	259624.SH	25 恒业 05	AA+	2.06 行权
2.22Y	152993.SH	21 长发 05	AAA	1.6
2.22Y	152993.SH	21 长发 05	AAA	1.6
2.22Y	152993.SH	21 长发 05	AAA	1.6
2.25Y+NY	115879.SH	铁工 YK08	AAA	1.63 行权
2.26Y+2Y	259858.SH	25 恒业 08	AA+	2.07 行权
2.26Y+2Y	259858.SH	25 恒业 08	AA+	2.07 行权
2.33Y	2526003.IB	25 富邦华一	AAA	1.73
2.44Y(休 1)	524507.SZ	25 先材 K1	AAA	1.77
2.44Y(休 1)	524507.SZ	25 先材 K1	AAA	1.77
2.44Y(休 1)	524507.SZ	25 先材 K1	AAA	1.77
2.45Y+NY	244122.SH	中粮 YK01	AAA	1.65 行权
2.45Y+NY	282380001.IB	23 泰康人寿永续债 01	AAA	1.79 行权
2.47Y	524529.SZ	25 广金 04	AAA	1.66
2.48Y+2Y	244101.SH	GK 隆基 01	AAA	2.4185 行权
2.5Y(休 2)	244259.SH	25 浙交 01	AAA	1.62
2.55Y+2Y(休 1)	280993.SH	25 海诺 01	AA+	1.87 行权
2.62Y+2Y	281175.SH	26 诸交 01	AA+	1.82 行权
2.66Y	524591.SZ	26 润置 01	AAA	1.845
2.67Y(休 2)	244602.SH	26 信科 K1	AAA	1.64
2.82Y+2Y	240760.SH	24 保利 03	AAA	2.10 行权
2.83Y+NY	148670.SZ	24 兴城 YK04	AAA	1.78 行权
2.85Y	244952.SH	26 船舶 K2	AAA	1.63
2.87Y	254419.SH	24 湾北 01	AA	1.86
2.88Y+NY(休 2)	244986.SH	26 长产 Y1	AAA	1.78 行权
2.88Y+NY(休 2)	244986.SH	26 长产 Y1	AAA	1.78 行权
2.88Y+NY(休 2)	244986.SH	26 长产 Y1	AAA	1.78 行权
2.89Y+2Y	245078.SH	26 保利 02	AAA	2.10 行权
2.9Y+1Y	152462.SH	20 济建设	AAA	1.71 行权
2.91Y	148714.SZ	24 中海 02	AAA	1.98
2.91Y	148714.SZ	24 中海 02	AAA	1.98
2.91Y	148714.SZ	24 中海 02	AAA	1.98
2.91Y	148714.SZ	24 中海 02	AAA	1.98
2.92Y+2Y(休 1)	282541.SH	26 楚水 01	AAA	1.85 行权
2.92Y+2Y(休 1)	282541.SH	26 楚水 01	AAA	1.85 行权
2.92Y+7Y(休 1)	520121.SZ	26 公控 K1	AA	1.94 行权
2.92Y(休 4)	2622007.IB	26 华夏金租绿色债 01	AAA	1.71
2.92Y+2Y	520142.SZ	26 眉投 K1	AAA	1.90 行权
2.92Y+2Y	520142.SZ	26 眉投 K1	AAA	1.90 行权

2.93Y(休 3)	282671.SH	26 长宁 01	AAA	1.825
2.97Y	254755.SH	24 平度 01	AA+	2.1
2.98Y	524804.SZ	26 国券 K2	AAA	1.65
2.98Y+2Y	245205.SH	26 张科 K1	AA+sti	1.81 行权
2.98Y+NY	245286.SH	电投 KY19	AAA	1.71 行权
3Y+NY	254863.SH	24 黄发 Y2	AA+	2.17 行权
3.13Y+5Y	272400005.IB	24 平安产险资本补充债 01	AAA	1.74 行权
3.4Y(休 1)	256065.SH	24 并投 04	AA+	1.91
3.41Y	148974.SZ	24 广新 K1	AAA	1.71
3.41Y	148974.SZ	24 广新 K1	AAA	1.71
3.76Y+NY	282580002.IB	25 泰康人寿永续债 01	AAA	1.92 行权
3.77Y+NY(休 1)	282580003.IB	25 平安人寿永续债 01	AAA	1.925 行权
3.77Y+NY(休 1)	282580003.IB	25 平安人寿永续债 01	AAA	1.925 行权
3.77Y+NY(休 1)	282580003.IB	25 平安人寿永续债 01	AAA	1.93 行权
3.77Y+NY(休 1)	282580003.IB	25 平安人寿永续债 01	AAA	1.93 行权
3.77Y+NY(休 1)	282580003.IB	25 平安人寿永续债 01	AAA	1.93 行权
3.77Y+NY(休 1)	282580003.IB	25 平安人寿永续债 01	AAA	1.93 行权
3.98Y+NY	242994.SH	25 中化 Y4	AAA	1.88 行权
4.07Y	259010.SH	25 绵控 05	AA+	2.09
4.12Y	243242.SH	25 电控 K4	AAA	1.745
4.12Y	243242.SH	25 电控 K4	AAA	1.745
4.2Y	243443.SH	25 沪资 01	AAA	1.755
4.23Y	259814.SH	25 郑高 01	AA+	2.14
4.23Y	259814.SH	25 郑高 01	AA+	2.14
4.39Y	243916.SH	25 动能 04	AAA	1.92
4.48Y	244240.SH	25 湘建 03	AAA	2.15
4.51Y	524562.SZ	25 建工 01	AAA	2.1325
4.55Y+NY(休 1)	244384.SH	葛洲 YK13	AAA	1.79 行权
4.66Y	524641.SZ	26BOEK1	AAA	1.77
4.67Y+NY(休 1)	282680001.IB	26 中信保诚人寿永续债 01	AAA	2.12 行权
4.67Y+NY(休 1)	282680001.IB	26 中信保诚人寿永续债 01	AAA	2.12 行权
4.67Y+NY(休 1)	282680001.IB	26 中信保诚人寿永续债 01	AAA	2.12 行权
4.67Y+NY(休 1)	282680001.IB	26 中信保诚人寿永续债 01	AAA	2.12 行权
4.67Y+NY(休 1)	282680001.IB	26 中信保诚人寿永续债 01	AAA	2.12 行权
4.68Y+2Y(休 2)	134835.SZ	26 深建 01	AAA	2.00 行权
4.68Y	032680064.IB	26 摩根士丹利 PPN001BC	AAA	2.075
4.77Y	524681.SZ	26 蓉金 01	AAA	1.83
4.84Y+2Y	244930.SH	26 财金 02	AAA	1.86 行权
4.84Y	134997.SZ	26 绍城 03	AAA	1.97
4.92Y+10Y	152835.SH	21 鄂科 01	AAA	1.98 行权
4.92Y+10Y	152835.SH	21 鄂科 01	AAA	1.98 行权
4.98Y+NY(休 1)	524803.SZ	26 广发 Y3	AAA	2.02 行权
5Y+NY	282680004.IB	26 泰康养老永续债 01	2.12 行权	2000
5Y+NY	282680004.IB	26 泰康养老永续债 01	2.13 行权	1000
6.91Y(休 2)	245098.SH	26 锡交 02	AAA	2.03
8.56Y	032481626.IB	24 乌城投 PPN002B	AAA	2.49
8.56Y	032481626.IB	24 乌城投 PPN002B	AAA	2.49
8.96Y(休 1)	242981.SH	25GTHK2	AAA	2.06
8.96Y(休 1)	242981.SH	25GTHK2	AAA	2.07
8.96Y(休 1)	242981.SH	25GTHK2	AAA	2.07
8.96Y(休 1)	242981.SH	25GTHK2	AAA	2.07
9.44Y(休 2)	244135.SH	25 国新 K1	AAA	2.11
9.44Y(休 2)	244135.SH	25 国新 K1	AAA	2.11
9.46Y(休 1)	244189.SH	25 国新 K2	AAA	2.11
9.46Y(休 1)	244189.SH	25 国新 K2	AAA	2.11

9.46Y(休 1)	244189.SH	25 国新 K2	AAA	2.11
9.48Y	252701.IB	25 汇金 01	AAA	1.9
9.78Y	244810.SH	26CHNG2K	AAA	2.1
28.72Y	2580014.IB	25 铁道 02	AAA	2.43
28.81Y	2580024.IB	25 铁道 06	AAA	2.435
28.81Y	2580024.IB	25 铁道 06	AAA	2.435
28.81Y	2580024.IB	25 铁道 06	AAA	2.4375
29.87Y	2680013.IB	26 铁道 07	AAA	2.43
29.98Y	2680018.IB	G26 铁道 2	AAA	2.43
29.98Y	2680018.IB	G26 铁道 2	AAA	2.44
29.98Y	2680018.IB	G26 铁道 2	AAA	2.44
29.98Y	2680018.IB	G26 铁道 2	AAA	2.43
16D	2320022.IB	23 杭州银行 01	AAA	1.36
30D	2320025.IB	23 北京银行 01	AAA	1.36
62D	2320034.IB	23 北京银行 02	AAA	1.37
75D+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	1.405 行权
75D+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	1.405 行权
75D+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	1.405 行权
173D+NY	2120099.IB	21 哈尔滨银行永续债 02	AAA	2.41 行权
173D+NY	2120099.IB	21 哈尔滨银行永续债 02	AAA	2.42 行权
173D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.435 行权
182D+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	1.44 行权
182D+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	1.44 行权
183D+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA	1.46 行权
194D+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	1.455 行权
201D+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	1.46 行权
232D+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	1.45 行权
236D+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	1.45 行权
271D+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	1.4575 行权
333D(休 1)	212400004.IB	24 光大银行小微债	AAA	1.44
1Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	1.437
1Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	1.437
1Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	1.437
1Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	1.437
1Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	1.437
1Y	2420022.IB	24 湖州银行小微债	AA+	1.5
1.06Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	1.48 行权
1.08Y(休 2)	292480007.IB	24 加拿大银行债 01BC	AAA	1.66
1.26Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	1.5 行权
1.26Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	1.5 行权
1.33Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	1.505 行权
1.33Y	212400010.IB	24 中原银行小微债 01	AAA	1.51
1.33Y	212400010.IB	24 中原银行小微债 01	AAA	1.51
1.34Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	AAA	1.455
1.41Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	1.56 行权
1.42Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	1.505 行权
1.42Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	1.51 行权
1.46Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	1.51 行权
1.46Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	1.51 行权
1.59Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA	1.56 行权
1.59Y+5Y	092203005.IB	22 进出口行二级资本债 01	--/--	1.515 行权
1.59Y+5Y	092203005.IB	22 进出口行二级资本债 01	--/--	1.515 行权
1.59Y+5Y	092203005.IB	22 进出口行二级资本债 01	--/--	1.515 行权
1.73Y	212580001.IB	25 浙商银行债 01A	AAA	1.505
1.73Y	212580001.IB	25 浙商银行债 01A	AAA	1.505

1.73Y	212580001.IB	25 浙商银行债 01A	AAA	1.505
1.73Y	212580001.IB	25 浙商银行债 01A	AAA	1.505
1.73Y	212580001.IB	25 浙商银行债 01A	AAA	1.505
1.82Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.54 行权
1.83Y	222580001.IB	25 天津银行绿债 01	AAA	1.545
1.83Y(休 1)	2520004.IB	25 北京银行 01	AAA	1.505
1.83Y(休 1)	2520004.IB	25 北京银行 01	AAA	1.505
1.83Y(休 1)	2520004.IB	25 北京银行 01	AAA	1.505
1.83Y(休 1)	2520004.IB	25 北京银行 01	AAA	1.505
1.92Y	2528007.IB	25 浦发银行 01	AAA	1.485
1.96Y(休 2)	332580002.IB	25 兴业银行科创债 01	AAA	1.485
1.97Y	2528010.IB	25 农业银行科创债	AAA	1.47
1.97Y	2528010.IB	25 农业银行科创债	AAA	1.475
1.97Y	2528011.IB	25 交通银行科创债 01	AAA	1.47
1.97Y	2528011.IB	25 交通银行科创债 01	AAA	1.47
1.97Y	2528011.IB	25 交通银行科创债 01	AAA	1.475
1.99Y	2528015.IB	25 中国银行科创债 01	AAA	1.465
1.99Y	2528015.IB	25 中国银行科创债 01	AAA	1.465
2Y	332580006.IB	25 建行科创债 01A(BC)	AAA	1.47
2.05Y	2520018.IB	25 南京银行绿色债 01	AAA	1.47
2.06Y	2528019.IB	25 兴业银行绿色债 02	AAA	1.44
2.09Y	212580017.IB	25 江苏银行债 02BC	AAA	1.5
2.12Y+1Y	312510006.IB	25 中行 TLAC 非资本债 01(BC)	AAA	1.56 行权
2.13Y(休 2)	2520031.IB	25 厦门银行 01	AAA	1.525
2.33Y+NY	242380021.IB	23 建行永续债 02	AAA	1.59 行权
2.33Y+NY	242380021.IB	23 建行永续债 02	AAA	1.59 行权
2.43Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA	1.59 行权
2.47Y+1Y	312510014.IB	25 交行 TLAC 非资本债 03A(BC)	AAA	1.63 行权
2.47Y+1Y	312510014.IB	25 交行 TLAC 非资本债 03A(BC)	AAA	1.63 行权
2.47Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	1.59 行权
2.52Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	1.64 行权
2.52Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	1.64 行权
2.57Y	212580057.IB	25 江苏银行债 04BC	AAA	1.505
2.7Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.605 行权
2.7Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.61 行权
2.7Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.61 行权
2.7Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	1.61 行权
2.81Y+5Y(休 1)	1928003.IB	19 农业银行二级 01	AAA	1.62 行权
2.91Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	1.68 行权
2.92Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	1.68 行权
2.97Y+1Y	312610005.IB	26 交行 TLAC 非资本债 01BC	AAA	1.69 行权
2.98Y+1Y	312610009.IB	26 中行 TLAC 非资本债 01BC	AAA	1.68 行权
2.98Y+1Y	312610009.IB	26 中行 TLAC 非资本债 01BC	AAA	1.68 行权
2.98Y+1Y	312610009.IB	26 中行 TLAC 非资本债 01BC	AAA	1.685 行权
2.98Y+1Y	312610009.IB	26 中行 TLAC 非资本债 01BC	AAA	1.685 行权
2.98Y+1Y	312610009.IB	26 中行 TLAC 非资本债 01BC	AAA	1.685 行权
2.98Y+1Y	312610009.IB	26 中行 TLAC 非资本债 01BC	AAA	1.69 行权
2.99Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	1.66 行权
2.99Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	1.66 行权
3.13Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	1.69 行权
3.13Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	1.69 行权
3.16Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	1.65 行权
3.16Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	1.6525 行权
3.18Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	1.69 行权

3.19Y+5Y(休 2)	232400032.IB	24 成都银行二级资本债 02	AAA	1.7375 行权
3.22Y+5Y	1928020.IB	19 交通银行二级 02	AAA	1.655 行权
3.22Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	1.685 行权
3.25Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	1.695 行权
3.25Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	1.695 行权
3.26Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.665 行权
3.26Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.665 行权
3.26Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.6675 行权
3.42Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	1.685 行权
3.43Y+NY	242400029.IB	24 民生银行永续债 02	AAA	1.87 行权
3.5Y+NY(休 1)	242400033.IB	24 广发银行永续债 02	AAA	1.79 行权
3.5Y+NY(休 1)	242400033.IB	24 广发银行永续债 02	AAA	1.79 行权
3.54Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	AAA	1.73 行权
3.54Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	AAA	1.735 行权
3.59Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.695 行权
3.77Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	1.72 行权
3.77Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	1.72 行权
3.78Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	1.845 行权
3.88Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	1.83 行权
3.91Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	1.8625 行权
3.91Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	1.8625 行权
3.91Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	1.865 行权
3.91Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	1.865 行权
3.91Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	1.875 行权
3.91Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	1.875 行权
3.93Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	1.74 行权
3.98Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	1.785 行权
4.01Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC	AAA	1.82 行权
4.01Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC	AAA	1.82 行权
4.01Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC	AAA	1.82 行权
4.04Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	1.82 行权
4.04Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	1.82 行权
4.06Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.76 行权
4.47Y+NY	242580048.IB	25 长沙银行永续债 01	AAA	1.99 行权
4.47Y+NY	242580048.IB	25 长沙银行永续债 01	AAA	1.99 行权
4.48Y+NY(休 1)	242580049.IB	25 厦门银行永续债 01	AAA	2.05 行权
4.58Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	1.8525 行权
4.87Y+5Y	232680001.IB	26 工行二级资本债 01BC	AAA	1.8625 行权
4.87Y+5Y	232680001.IB	26 工行二级资本债 01BC	AAA	1.87 行权
4.87Y+5Y	232680001.IB	26 工行二级资本债 01BC	AAA	1.87 行权
4.87Y+5Y	232680001.IB	26 工行二级资本债 01BC	AAA	1.87 行权
4.87Y+5Y	232680001.IB	26 工行二级资本债 01BC	AAA	1.87 行权
4.87Y+5Y	232680001.IB	26 工行二级资本债 01BC	AAA	1.871 行权
4.87Y+NY	242680001.IB	26 中信银行永续债 01BC	AAA	1.94 行权
4.87Y+NY	242680001.IB	26 中信银行永续债 01BC	AAA	1.94 行权
4.87Y+NY	242680001.IB	26 中信银行永续债 01BC	AAA	1.94 行权
4.87Y+NY	242680001.IB	26 中信银行永续债 01BC	AAA	1.94 行权
4.88Y+NY	242680002.IB	26 招商银行永续债 01	AAA	1.94 行权
4.9Y+5Y	232680003.IB	26 中行二级资本债 01BC	AAA	1.8725 行权
4.9Y+5Y	232680003.IB	26 中行二级资本债 01BC	AAA	1.8725 行权
4.9Y+5Y	232680003.IB	26 中行二级资本债 01BC	AAA	1.8725 行权
4.9Y+5Y	232680003.IB	26 中行二级资本债 01BC	AAA	1.8725 行权
4.91Y+NY	242680005.IB	26 兴业银行永续债 01BC	AAA	1.94 行权
4.91Y+NY	242680005.IB	26 兴业银行永续债 01BC	AAA	1.94 行权
4.92Y+5Y(休 1)	232680004.IB	26 交行二级资本债 01BC	AAA	1.865 行权

9.89Y+1Y	312610003.IB	26 农行 TLAC 非资本债 01C(BC)	AAA	2.13 行权
9.96Y+5Y(休 1)	232680006.IB	26 农行二级资本债 01B(BC)	AAA	2.13 行权
9.98Y+1Y	312610008.IB	26 农行 TLAC 非资本债 02C(BC)	AAA	2.1225 行权
9.98Y+1Y	312610008.IB	26 农行 TLAC 非资本债 02C(BC)	AAA	2.1225 行权
9.98Y+1Y	312610008.IB	26 农行 TLAC 非资本债 02C(BC)	AAA	2.1225 行权
9.98Y+1Y	312610008.IB	26 农行 TLAC 非资本债 02C(BC)	AAA	2.1225 行权

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。