



【2024-09-30】

国债

央行公告称，为维护季末银行体系流动性合理充裕，9月30日以固定利率、数量招标方式开展2121亿元7天期逆回购操作，操作利率1.50%。Wind数据显示，当日有1601亿元逆回购到期，单日净投放520亿元。

国债方面 298D 240015 1.355-1.4；2.62Y 240010 1.635-1.65；4.79Y 240014 1.81-1.88；6.73Y 240013 2.07-2.14；9.65Y 240011 2.15-2.23；29.04Y 230023 2.3225-2.42。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.4300	1.6600	1.9100	2.1490	2.2350	2.4350
今日国债(%)	1.3500	1.6250	1.8300	2.0700	2.1575	2.3500
变动(%)	-0.0800	-0.0350	-0.0800	-0.0790	-0.0775	-0.0850

金融债

金融债方面 295D 240308 1.65-1.7；4.4Y 240203 1.925-2.0；9.6Y 240210 2.2375-2.34。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.7000	1.9300	2.0000	2.1500	2.3300
今日非国开金融债(%)	1.7000	1.8650	1.9500	2.0900	2.2600
变动(%)	0.0000	-0.0650	-0.0500	-0.0600	-0.0700
昨日国开债(%)	1.7100	1.9000	2.0200	2.2200	2.3400
今日国开债(%)	1.7000	1.8500	1.9250	2.1500	2.2550
变动(%)	-0.0100	-0.0500	-0.0950	-0.0700	-0.0850

短期融资券

今日银行间短融市场交投较为一般，基成交主要集中于Q4期限。短端方面，49D 012480559.IB 24 鄂文旅 SCP001 AAA 在2.28%成交（估值位置），基金出给券商；65D 042380725.IB 23 淄博城运 CP002 AAA 在2.30%成交（估值-1位置），基金出给基金；中长端方面，144D 012482434.IB 24 沪百联 SCP002 AAA 在2.20%成交（估值+2位置），基金出给基金；91D 012481557.IB 24 中材科技 SCP002(科创票据) AAA 在2.21%成交（估值位置），基金出给基金；长端方面，221D 012482448.IB 24 淮南矿 SCP005 AAA 在2.31%成交（估值位置），理财出给基金；200D 012482444.IB 24 鲁钢铁 SCP010 AAA 在2.31%成交（估值位置），理财出给基金；短端，中长端收益率震荡。

	评级	1M	3M	6M	9M	12M
--	----	----	----	----	----	-----

绝对收益率	AAA	2.07		2.15		2.08		2.1		2.13	
	AA+	2.4		2.1		2.15		2.15		2.28	
	AA	2.2		2.2		2.3		2.3		2.4	
	AA-	2.4		2.2		2.35		2.35		2.44	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	2.25	-18	2.05	10	2.08	0	2.1	0	2.13	0
	AA+	2.4	0	2.1	0	2.12	3	2.15	0	2.2	8
	AA	2.5	-30	2.2	0	2.25	5	2.3	0	2.5	-10
	AA-	2.6	-20	2.4	-20	2.6	-25	2.75	-40	2.95	-51

中期票据

今日中票交投情绪较为平淡，1-3 年短端中票，22 南航集 MTN001（AAA，1.08Y）在 2.23%估值位置成交；23 光大控股 MTN001（AAA，1.88Y）在 2.41%高估值 7bp 位置成交；24 邮政 MTN001（AAA，2.63Y）在 2.32%高估值 4bp 位置成交；3 到 5 年期限，24 南电 MTN002（AAA，4.41Y）在 2.33%估值位置成交；24 汇金 MTN003（AAA，4.64Y）分别成交在 2.36%、2.37%，高估值 3 或 4bp 的位置；24 汇金 MTN007（AAA，4.98Y）成交在 2.37%，高估值 3bp 位置。5Y 及以上期限，24 苏交通 MTN011（AAA，9.87Y）在 2.55%高估值 2bp 位置成交；24 青岛地铁 MTN002B（AAA，9.99Y）成交在 3.00%，高估值 13bp 位置。总体而言，今日中票收益继续上行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.2		2.25		2.37		None		2.58	
	AAA	2.3		2.36		2.5		None		2.66	
	AA+	2.42		2.52		2.67		None		None	
	AA	2.5		2.62		3		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.2	0	2.25	0	2.35	2	None	None	2.58	0
	AAA	2.28	2	2.35	1	2.5	0	None	None	2.65	1
	AA+	2.4	2	2.5	2	2.65	2	None	None	None	None
	AA	2.5	0	2.6	2	3	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 山高 01 AAA 成交在 2.16%，基金卖出，券商买入。21 北水 Y2 AAA 成交在 2.25%，券商卖出，基金买入。21 国新 04 AAA 成交在 2.05%，基金卖出，基金买入。城投方面，22 兴投 03 AAA 成交在 2.43%，基金卖出，基金买入。23 洛建 06 AA+ 成交在 2.50%。23 漯河 02 AA 成交在 2.75%。长端方面，24 蓉金 02 AAA 成交在 2.85%，基金卖出，基金买入。24 北控 K2 AAA 成交在 2.62%。23 亦庄 06 AAA 成交在 2.76%。

银行债

今日银行债交投活跃，收益率震荡下行。早盘受昨日空头情绪堆积影响成交先 gvn 在+6 附近，（4.83Y）24 中行永续债 01 GVN 2.54%（+5.93），基金出给理财。随后情绪有所好转，利率企稳在估值附近，（4.91Y）24 工行二级资本债 01A(BC) TKN 2.44%(-0.09)，基金之间易手。随后收益率开始在+3 到估值附近小幅震荡。下午配置盘开始陆续出现，买盘意愿强烈，收益率再次下行。截止至尾盘，五年二永成交在估值-2 附近。（4.91Y）24 工行二级资本债 01A(BC) TKN 2.42%(-1.91)，券商出给银行资管。短端方面，1 年内二永今天波动较大，早盘受资金面影响，成交在估值+7 附近，（282D）20 招商银行永续债 01 GVN 2.30%(+7.55)，理财直接易手。午后资金面有所好转，短券出现一波 TKN，20 招商银行永续债 01 成交在 2.23%（+0.55）。商金方面，银行买盘活跃，（2.94Y）24 浙商银行债 01 在 2.20%（+1.54）位置成交数笔，基金出给银行。

美元债

月末季末叠加假期，今天外币债市场交投清淡。TMT 板块，仍有实钱买盘加仓，收窄 1-2bp。金融板块，基本不变。城投板块，询价集中在高收益城投债，其中美元债的昆明轨交、昆明产投和点心债的贵溪发投、孝感高创询价较多，但分歧大。房地产板块，万科、龙湖上涨 0.5-1pt。

剩余天数	债券代码	债券代码（发行机构）	评级
11D	012482071.IB	24 上海机场 SCP007	AAA
11D	012482071.IB	24 上海机场 SCP007	AAA
16D	012481349.IB	24 渝医药 SCP004	AA+
16D	012481349.IB	24 渝医药 SCP004	AA+
18D	012483010.IB	24 大唐集 SCP003	AAA
18D	012481159.IB	24 浙交投 SCP007	AAA
18D	042380596.IB	23 云能投 CP013	AAA
18D	042380596.IB	23 云能投 CP013	AAA
22D	072410057.IB	24 东财证券 CP005	AAA
25D	042380606.IB	23 今世缘 CP004	AA+
25D	042380606.IB	23 今世缘 CP004	AA+
46D	042380637.IB	23 华阳新材 CP004	AAA
49D	012480559.IB	24 鄂文旅 SCP001	AAA
50D	072410071.IB	24 东财证券 CP006	AAA
51D	012481648.IB	24 国能资本 SCP004	AAA
58D	012481023.IB	24 瀚瑞投资 SCP002	AA+
65D	042380725.IB	23 淄博城运 CP002	AAA
69D(休 1)	012480848.IB	24 鲁黄金 SCP002(科创票据)	AAA
74D	012480919.IB	24 津保投 SCP005	AAA
78D	012481035.IB	24 常德经建 SCP001	AA+
78D	012480994.IB	24 吴中经发 SCP005	AA+
78D	012480994.IB	24 吴中经发 SCP005	AA+
78D	012480994.IB	24 吴中经发 SCP005	AA+
86D	012483204.IB	24 南通沿海 SCP009	AAA
91D	012481557.IB	24 中材科技 SCP002(科创票据)	AAA
91D	012481557.IB	24 中材科技 SCP002(科创票据)	AAA
91D	012481557.IB	24 中材科技 SCP002(科创票据)	AAA
95D	012481224.IB	24 吴中经发 SCP006	AA+
109D	012481374.IB	24 柳钢集团 SCP004(科创票据)	AAA
109D	012481374.IB	24 柳钢集团 SCP004(科创票据)	AAA
116D	012481586.IB	24 南海控股 SCP003	AAA
116D	012481585.IB	24 首钢 SCP003	AAA
129D	042480077.IB	24 扬州绿产 CP001	AA
141D	012400349.IB	24 渝惠通 SCP001	AA+
141D	012400349.IB	24 渝惠通 SCP001	AA+
144D	012482434.IB	24 沪百联 SCP002	AAA
144D	012482434.IB	24 沪百联 SCP002	AAA
149D	042480095.IB	24 平安租赁 CP001	AAA
159D(休 2)	042480125.IB	24 亳州交通 CP001	AA
169D	042480153.IB	24 方洋 CP001	AA+
176D	012482011.IB	24 创元投资 SCP007	AAA
193D	072410108.IB	24 东财证券 CP010	AAA
193D	042480202.IB	24 成都香城 CP001	AA
193D	042480202.IB	24 成都香城 CP001	AA
193D	042480202.IB	24 成都香城 CP001	AA
199D	042480216.IB	24 西江 CP001	AA+
200D	012482444.IB	24 鲁钢铁 SCP010	AAA
219D	042480255.IB	24 高淳建设 CP007	AA
221D	012482448.IB	24 淮南矿 SCP005	AAA
236D(休 2)	012482583.IB	24 青岛西海 SCP002	AAA
249D	072410083.IB	24 东兴证券 CP001	AAA

253D	012483054.IB	24 冀中峰峰 SCP001	AA+
256D	072410085.IB	24 国金证券 CP001	AAA
277D	042480342.IB	24 杭州水务 CP001(科创票据)	AAA
277D	042480342.IB	24 杭州水务 CP001(科创票据)	AAA
318D	042480406.IB	24 青岛上合 CP003	AAA
323D	042480483.IB	24 电网 CP020	AAA
324D	042480490.IB	24 电网 CP024	AAA
340D	042480453.IB	24 桂交投 CP006	AAA

今日中票成交

剩余天数	债券代码	债券代码（发行机构）	评级
22D	102102105.IB	21 中铝集 MTN005	AAA
22D	102102105.IB	21 中铝集 MTN005	AAA
24D	101901435.IB	19 津城建 MTN009B	AAA
24D	101901448.IB	19 汇金 MTN018	AAA
28D	102102171.IB	21 浦软件园 MTN001	AA+
46D+2Y(休 1)	102102305.IB	21 宿迁交通 MTN001	AA+
46D	102102299.IB	21 海沧投资 MTN003	AA+
49D+2Y	102180027.IB	21 青山湖科 MTN001	AA+
57D+NY	102103108.IB	21 余姚城投 MTN003	AA+
62D(休 1)	102103136.IB	21 长沙水业 MTN001(绿色)	AA+
63D+NY(休 1)	102282616.IB	22 中电投 MTN039	AAA
70D	132100161.IB	21 昆山城投 GN001(项目收益)	AAA
79D	101901711.IB	19 香城投资 MTN001	AA+
80D	101901732.IB	19 平湖国资 MTN002	AA+
81D	101901731.IB	19 港兴港投 MTN005	AAA
81D	101901731.IB	19 港兴港投 MTN005	AAA
84D+NY(休 1)	102282768.IB	22 国开投 MTN002	AAA
84D+NY(休 1)	102282768.IB	22 国开投 MTN002	AAA
84D+NY(休 1)	102282768.IB	22 国开投 MTN002	AAA
98D	102280020.IB	22 泸州窖 MTN001	AAA
106D	102280101.IB	22 河钢集 MTN001	AAA
132D+NY(休 1)	102380158.IB	23 华电股 MTN002(能源保供特别债)	AAA
144D	102382333.IB	23 豫航空港 MTN012	AAA
151D+NY	102380334.IB	23 华电 MTN003A(能源保供特别债)	AAA
151D+NY	102380334.IB	23 华电 MTN003A(能源保供特别债)	AAA
157D	102000247.IB	20 华为 MTN001	AAA
158D	102280432.IB	22 长沙水业 MTN001	AA+
158D	102280441.IB	22 宁波通商 MTN001	AAA
161D	102000284.IB	20 中燃气(疫情防控债)MTN001	AAA
162D	102480456.IB	24 潞安 MTN001	AAA
162D	102280492.IB	22 武金控 MTN001	AAA
174D(休 1)	102280596.IB	22 义乌商品 MTN002	AA+
174D(休 1)	102280596.IB	22 义乌商品 MTN002	AA+
190D	102280734.IB	22 广州资管 MTN001	AAA
190D+2Y	102280737.IB	22 光大绿环 MTN001BC(绿色)	AAA
190D+2Y	102280737.IB	22 光大绿环 MTN001BC(绿色)	AAA
202D(休 1)	102280860.IB	22 泉州城建 MTN001A	AAA
203D	102280868.IB	22 华润资产 MTN001	AAA
203D	102280868.IB	22 华润资产 MTN001	AAA
203D	102280868.IB	22 华润资产 MTN001	AAA
206D+NY	102381022.IB	23 中电投 MTN013(能源保供特别债)	AAA

207D	102382900.IB	23 豫航空港 MTN015	AAA
210D	102280991.IB	22 邯郸交投 MTN001	AA+
222D+2Y	102281079.IB	22 成华棚改 MTN001	AA+
238D	102281121.IB	22 保利发展 MTN002(绿色)	AAA
242D	102281146.IB	22 河钢集 MTN008	AAA
242D	102281146.IB	22 河钢集 MTN008	AAA
260D	102001200.IB	20 沪金桥 MTN001	AAA
270D+2Y(休 1)	102200172.IB	22 龙城发展 MTN004	AAA
279D(休 1)	102281473.IB	22 上实 MTN002	AAA
283D	102381631.IB	23 青岛国信 MTN005	AAA
293D(休 1)	102281587.IB	22 中电国际 MTN003	AAA
294D	102281594.IB	22 浙国贸 MTN003	AAA
295D+NY	102281615.IB	22 中铝集 MTN001	AAA
311D	102001466.IB	20 沪建工 MTN001	AAA
315D+NY	102382030.IB	23 中电投 MTN032	AAA
322D	102382100.IB	23 萍乡创新 MTN001	AA+
322D	102382100.IB	23 萍乡创新 MTN001	AA+
326D+NY	102281416.IB	22 陕投集团 MTN003	AAA
333D	102382289.IB	23 环球租赁 MTN003	AAA
333D	102281960.IB	22 泉州城建 MTN002A	AAA
340D	102282025.IB	22 东方国际 MTN001	AAA
340D+NY	102382372.IB	23 晋能煤业 MTN005	AAA
346D	102480351.IB	24 华阳新材 MTN003	AAA
348D+NY(休 2)	102282071.IB	22 大唐集 MTN006(能源保供特别债)	AAA
348D+NY(休 2)	102282071.IB	22 大唐集 MTN006(能源保供特别债)	AAA
1Y	102001861.IB	20 湘高速 MTN005	AAA
1.05Y(休 1)	102282283.IB	22 太仓港 MTN004	AA/AA+
1.05Y(休 1)	102282277.IB	22 山东港口 MTN002	AAA
1.05Y(休 1)	102282277.IB	22 山东港口 MTN002	AAA
1.05Y+NY	102200235.IB	22 华润 MTN007	AAA
1.07Y+NY	102282334.IB	22 华能 MTN010	AAA
1.07Y+NY	102282334.IB	22 华能 MTN010	AAA
1.07Y+NY(休 2)	102382832.IB	23 华电 MTN008A	AAA
1.08Y	102382934.IB	23 镇国投 MTN005	AA+
1.08Y	102282412.IB	22 国投电力 MTN001	AAA
1.08Y	102282412.IB	22 国投电力 MTN001	AAA
1.08Y	102282414.IB	22 淮安国投 MTN002	AAA
1.09Y+NY(休 1)	102282434.IB	22 中电投 MTN033	AAA
1.14Y	102383096.IB	23 平安租赁 MTN006	AAA
1.18Y	102002224.IB	20 扬州交通 MTN001	AA+/AA
1.35Y	102380147.IB	23 连云工投 MTN002	AA
1.35Y	102480431.IB	24 渭南城投 MTN001	AA
1.4Y+2Y	102380299.IB	23 宁乡城投 MTN001	AA+
1.67Y	102381280.IB	23 南昌建投 MTN005	AAA
1.87Y(休 2)	101658045.IB	16 豫高管 MTN001	AAA
2.3Y	102400590.IB	24 晋能煤业 MTN002	AAA
2.57Y	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA
2.57Y	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA
2.72Y	102482414.IB	24 四川路桥 MTN002	AAA
2.86Y	102483457.IB	24 光明 MTN003	AAA
2.97Y	102484189.IB	24 国航 MTN002	AAA
2.97Y	102484189.IB	24 国航 MTN002	AAA

3.81Y+2Y	102381779.IB	23 诚通控股 MTN002A	AAA
3.81Y+2Y	102381779.IB	23 诚通控股 MTN002A	AAA
4.83Y	102483274.IB	24 嘉兴产业 MTN001	AA+
4.9Y(休 1)	102483749.IB	24 合建投 MTN004	AAA
9.79Y(休 2)	102400862.IB	24 建发集 MTN003	AAA
9.79Y(休 2)	102400862.IB	24 建发集 MTN003	AAA

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
21D	152298.SH	19 山高 01	AAA
25D+NY	188885.SH	21 北水 Y2	AAA
41D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA
43D+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA
43D+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA
43D	2128037.IB	21 民生银行 01	AAA
53D+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA
53D+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA
53D	185010.SH	21 海通 11	AAA
53D+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA
54D(休 2)	240302.SH	23 安信 S4	AAA/A-1
63D+4Y(休 2)	2180478.IB	21 洪山城投债	AA/AA+
64D+NY	1920076.IB	19 徽商银行永续债	AAA
64D+NY	1920076.IB	19 徽商银行永续债	AAA
64D	185083.SH	21 国新 04	AAA
77D+NY	138646.SH	22 铁工 Y5	AAA
78D	185141.SH	21 石化 01	AAA
103D(休 2)	149775.SZ	22 国信 01	AAA
104D(休 1)	149773.SZ	22 长城 01	AAA
109D	149781.SZ	22 长江 01	AAA
110D(休 2)	185255.SH	22 翔业 01	AAA
113D	149787.SZ	22 深机 01	AAA
144D	138931.SH	23 兴业 01	AAA
146D(休 1)	185402.SH	22 沪电 01	AAA
146D(休 1)	185402.SH	22 沪电 01	AAA
146D(休 1)	185402.SH	22 沪电 01	AAA
148D	185400.SH	22 海通 C2	AAA
148D	2220012.IB	22 浙商银行小微债 01	AAA
155D	163221.SH	20 诚通 03	AAA
159D(休 2)	149825.SZ	22 申宏 01	AAA
160D(休 1)	149831.SZ	22 华资 01	AAA
161D	032280271.IB	22 青岛城投 PPN001	AAA
161D	032280271.IB	22 青岛城投 PPN001	AAA
164D	115019.SH	23 红塔 03	AAA
166D(休 2)	092280004.IB	22 东方债 01BC	AAA
167D(休 1)	185542.SH	22 兴投 03	AAA
168D	2220019.IB	22 南京银行 01	AAA
169D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA
176D	149857.SZ	22 东北 01	AAA
192D	115192.SH	23 国金 02	AAA
192D	115192.SH	23 国金 02	AAA
192D	115192.SH	23 国金 02	AAA
192D	241124.SH	24 招 S14	AAA

192D	241124.SH	24 招 S14	AAA
193D	2228021.IB	22 民生银行 01	AAA
193D	2220031.IB	22 浙商银行小微债 02	AAA
196D	149094.SZ	20 华控 02	AAA
201D(休 2)	115260.SH	23 中证 G6	AAA
209D(休 1)	032280455.IB	22 余杭创新 PPN001	AAA
209D(休 1)	149900.SZ	22 国元 01	AAA
210D	2221016.IB	22 成都农商绿色债	AAA
211D	185716.SH	22 吴城 G2	AA+
218D+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA
223D(休 1)	185758.SH	22 兴投 05	AAA
233D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA
237D(休 1)	149919.SZ	22 长江 C1	AAA/AA+
242D	2228034.IB	22 广发银行 02	AAA
260D	149949.SZ	22 西部 06	AAA
270D+2Y(休 1)	185930.SH	22 漳九 06	AAA
282D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA
282D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA
282D+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA
283D	115591.SH	23 信投 C3	AAA
284D	2220056.IB	22 北部湾银行绿色债 01	AAA
286D+NY(休 1)	149983.SZ	22 深能 Y1	AAA
293D(休 1)	163750.SH	20 张江一	AAA
298D	137563.SH	22 平证 05	AAA
298D	137563.SH	22 平证 05	AAA
299D(休 2)	185393.SH	22 招证 G2	AAA
307D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA
313D(休 2)	2228047.IB	22 恒丰银行 02	AAA
316D	137652.SH	22 北汽 01	AAA
318D+5Y	2028024.IB	20 中信银行二级	AAA
318D+5Y	2028024.IB	20 中信银行二级	AAA
326D	252116.SH	23 洛建 06	AA+
328D+NY(休 1)	2028032.IB	20 农业银行永续债 02	AAA
332D	252218.SH	23 漯河 02	AA
334D+3Y	252058.SH	23 商铁 03	AA
346D	138979.SH	23 招证 C1	AAA
352D+5Y	2028034.IB	20 浦发银行二级 03	AAA
356D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA
356D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA
356D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA
356D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA
357D	252541.SH	23 株高 05	AA+
359D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA
359D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA
359D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA
359D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA
359D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA
363D+5Y(休 2)	2020065.IB	20 徽商银行二级 01	AAA
1.05Y(休 2)	252608.SH	23 新余 05	AA
1.07Y(休 1)	1880196.IB	18 长沙城北债 02	AA/AA+
1.07Y+3Y	175302.SH	20 青城 04	AAA
1.11Y(休 2)	137911.SH	22 凤凰 01	AAA

1.12Y	2080356.IB	20 中国诚通债转股债 02	AAA
1.12Y	2228057.IB	22 浦发银行 04	AAA
1.15Y+NY	2028052.IB	20 恒丰银行永续债	AAA
1.21Y(休 1)	2228060.IB	22 建设银行三农债	AAA
1.22Y	240424.SH	23 招证 13	AAA
1.49Y	148223.SZ	23 申证 C3	AAA
1.49Y(休 1)	2328006.IB	23 交通银行小微债 01	AAA
1.49Y(休 1)	2328006.IB	23 交通银行小微债 01	AAA
1.53Y	2320013.IB	23 上海银行 01	AAA
1.53Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA
1.53Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA
1.53Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA
1.53Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA
1.55Y	2320016.IB	23 北京银行小微债 01	AAA
1.57Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA
1.63Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA
1.63Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA
1.63Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA
1.63Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA
1.63Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA
1.68Y+5Y(休 2)	2120047.IB	21 宁波银行二级 01	AAA
1.69Y+NY	115476.SH	23 鄂担 Y3	AAA
1.69Y+NY	115476.SH	23 鄂担 Y3	AAA
1.69Y+NY	115476.SH	23 鄂担 Y3	AAA
1.69Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA
1.69Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA
1.69Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA
1.69Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA
1.69Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA
1.69Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA
1.69Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA
1.72Y(休 2)	241154.SH	24 广越 05	AAA
1.78Y(休 1)	2320026.IB	23 徽商银行	AAA
1.78Y(休 1)	2320026.IB	23 徽商银行	AAA
1.82Y(休 1)	212380013.IB	23 浙商银行债 01	AAA
1.82Y(休 1)	212380013.IB	23 浙商银行债 01	AAA
1.84Y(休 2)	212380010.IB	23 华夏银行债 03	AAA
1.84Y(休 2)	212380010.IB	23 华夏银行债 03	AAA
1.86Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA
1.9Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA
1.9Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA
1.9Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA
1.9Y	2320041.IB	23 南京银行 01	AAA
1.9Y	2320041.IB	23 南京银行 01	AAA
1.91Y	2320043.IB	23 杭州银行 02	AAA
1.91Y	2320043.IB	23 杭州银行 02	AAA
1.91Y	2320043.IB	23 杭州银行 02	AAA
1.99Y(休 2)	212380021.IB	23 交行债 02	AAA
2.05Y+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA
2.07Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA
2.07Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA
2.08Y(休 2)	2320052.IB	23 湖南银行绿色债 01	AAA

2.11Y	212380023.IB	23 光大银行债 03	AAA
2.11Y	212380023.IB	23 光大银行债 03	AAA
2.12Y+5Y	2128036.IB	21 平安银行二级	AAA
2.13Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA
2.13Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA
2.15Y+10Y	2180465.IB	21 宜控绿色债	AA+
2.15Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA
2.15Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA
2.15Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA
2.15Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA
2.16Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA
2.16Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA
2.16Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA
2.16Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA
2.16Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA
2.16Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA
2.16Y+NY	2120107.IB	21 浙商银行永续债	AAA
2.19Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA
2.19Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA
2.19Y+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA
2.2Y(休 1)	253278.SH	23 晋旅 02	AA+
2.24Y+5Y(休 2)	2121062.IB	21 北京农商二级	AAA
2.24Y+5Y(休 2)	2121062.IB	21 北京农商二级	AAA
2.24Y+5Y(休 2)	2121062.IB	21 北京农商二级	AAA
2.29Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA
2.29Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA
2.29Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA
2.3Y+NY(休 1)	2220002.IB	22 苏州银行永续债 01	AAA/AA+
2.3Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA
2.4Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA
2.42Y	212480001.IB	24 建行债 01A	AAA
2.42Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA
2.43Y+5Y(休 1)	2221006.IB	22 上海农商二级 01	AAA
2.43Y+5Y(休 1)	2221006.IB	22 上海农商二级 01	AAA
2.44Y	240681.SH	24 银河 C1	AAA
2.44Y	240681.SH	24 银河 C1	AAA
2.47Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA
2.49Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02	AAA
2.49Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02	AAA
2.53Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA
2.53Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA
2.53Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA
2.53Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA
2.54Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA
2.57Y(休 1)	212400004.IB	24 光大银行小微债	AAA
2.57Y(休 1)	212400004.IB	24 光大银行小微债	AAA
2.57Y	185687.SH	22 创投 K1	AAA
2.57Y	185687.SH	22 创投 K1	AAA
2.58Y+NY	2221017.IB	22 重庆农商永续债	AAA
2.58Y+NY	2221017.IB	22 重庆农商永续债	AAA
2.58Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	AAA
2.58Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	AAA

2.58Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	AAA
2.58Y	212480010.IB	24 长沙银行债 01	AAA
2.64Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA
2.64Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA
2.65Y	2420019.IB	24 徽商银行 01	AAA
2.78Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA
2.78Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA
2.85Y(休 1)	137581.SH	22 鲁资 10	AAA
2.85Y(休 1)	137581.SH	22 鲁资 10	AAA
2.85Y(休 1)	137581.SH	22 鲁资 10	AAA
2.85Y(休 1)	137581.SH	22 鲁资 10	AAA
2.87Y+1Y(休 2)	312410003.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01A	AAA
2.87Y	2421008.IB	24 顺德农商小微债 01	AAA
2.87Y	2421008.IB	24 顺德农商小微债 01	AAA
2.9Y	127591.SH	PR 吴国太	AA+
2.9Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA
2.92Y+1Y	312410005.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)	AAA
2.92Y+1Y	312410005.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)	AAA
2.92Y+1Y	312410005.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)	AAA
2.92Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA
2.92Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA
2.93Y+NY(休 1)	092280086.IB	22 农行永续债 02	AAA
2.94Y	182629.SH	22 湖城 02	AAA
2.94Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA
2.94Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA
2.94Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA
2.94Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA
2.94Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA
2.98Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA
2.98Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA
2.98Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA
2.99Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	AAA
3.07Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA
3.07Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA
3.07Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA
3.07Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA
3.07Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA
3.07Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA
3.1Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA
3.11Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA
3.11Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA
3.11Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA
3.11Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA
3.11Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA
3.25Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+
3.48Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA
3.48Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA
3.53Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA
3.66Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01	AAA
3.66Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01	AAA
3.66Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01	AAA
3.71Y+NY	242380008.IB	23 中行永续债 01	AAA

3.8Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA
3.8Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA
3.8Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA
3.8Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA
3.8Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA
3.8Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA
3.8Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA
3.8Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA
3.8Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA
3.8Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA
3.87Y+NY	242380015.IB	23 成都农商行永续债 01	AAA
3.87Y+NY	242380015.IB	23 成都农商行永续债 01	AAA
3.91Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA
3.91Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA
3.91Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA
3.91Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA
3.91Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA
3.91Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA
3.99Y+NY	242380021.IB	23 建行永续债 02	AAA
3.99Y+NY	242380021.IB	23 建行永续债 02	AAA
4.05Y+NY	242380019.IB	23 邮储永续债 01	AAA
4.05Y+NY	242380019.IB	23 邮储永续债 01	AAA
4.06Y+5Y(休 1)	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A	AAA
4.08Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA
4.13Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA
4.17Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA
4.28Y+2Y	240453.SH	24 兴沪 02	AA+
4.34Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA
4.35Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA
4.42Y	212480002.IB	24 建行债 01B	AAA
4.47Y+5Y(休 1)	1928003.IB	19 农业银行二级 01	AAA
4.48Y+5Y(休 2)	1928007.IB	19 工商银行二级 02	AAA
4.52Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA
4.52Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA
4.56Y(休 1)	254544.SH	24 上饶 04	AA+
4.56Y+5Y(休 2)	232400013.IB	24 渤海银行二级资本债 01	AAA
4.56Y+5Y(休 2)	232400013.IB	24 渤海银行二级资本债 01	AAA
4.56Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA
4.56Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA
4.56Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA
4.57Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA
4.57Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA
4.57Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA
4.58Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA
4.58Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA
4.58Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA
4.62Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA
4.62Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA
4.62Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA
4.63Y+1Y	312400002.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01B	AAA
4.64Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA
4.64Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA

[illegible]

4.88Y+NY(休 1)	242400016.IB	24 民生银行永续债 01	AAA
4.88Y+NY(休 1)	242400016.IB	24 民生银行永续债 01	AAA
4.91Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA
4.91Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA
4.91Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA
4.91Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA
4.91Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA
4.91Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA
4.91Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA
4.91Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA
4.91Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA
4.91Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA
4.91Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA
4.99Y+NY	232480067.IB	24 华夏银行永续债 02	AAA
4.99Y+NY	232480067.IB	24 华夏银行永续债 02	AAA
9.12Y(休 1)	240244.SH	23 亦庄 06	AAA
9.54Y(休 2)	240899.SH	24 北控 K2	AAA
9.57Y+5Y	232480012.IB	24 农行二级资本债 02B	AAA
9.82Y+5Y	232480038.IB	24 交行二级资本债 02B	AAA
9.85Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA
9.85Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA

文 / Derek Huang, Liyuan Zhong, Austin Lin

联系人：Xiaoting Bu
邮箱：Xiaoting.Bu@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