



【2023-08-01】

国债

今日央行开展 80 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 440 亿，全口径资金净回笼 360 亿。Shibor 利率短端下行，长端上行或持平，其中隔夜品种报 1.5580%，下行 28.90 个基点；7 天品种报 1.8060%，下行 15.70 个基点；1 个月品种报 2.0560%，下行 0.90 个基点；3 个月品种报 2.0980%，上行 0.10 个基点。今日资金面早盘均衡，午后逐步转松。

国债方面 167D 239941 1.79, 359D 230016 1.77-1.80, 279Y 230011 2.225-2.2325, 3.03Y 210011 2.255-2.263, 4.7Y 230008 2.4375-2.45, 6.65Y 230006 2.615-2.625, 9.81Y 230012 2.6525-2.659, 29.7Y 230009 2.9975-3.0025

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.5900	2.2300	2.4525	2.5700	2.7000	3.0310
今日国债(%)	1.5900	2.2250	2.4450	2.5575	2.6950	3.0300
变动(%)	0.0000	-0.0050	-0.0075	-0.0125	-0.0050	-0.0010

金融债

金融债方面 160D 210202 1.825-1.83, 225D 230301 1.95, 1.89Y 200208 2.29-2.305, 2.45Y 230202 2.3625-2.375, 3.87Y 220208 2.535-2.545, 4.45Y 230203 2.5525-2.565, 6.61Y 200205 2.7425, 9.81Y 230210 2.753-2.7625, 18.27Y 210220 3.04-3.045

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.9600	2.2600	2.5300	2.7250	2.8675
今日非国开金融债(%)	1.9500	2.2550	2.5200	2.7100	2.8650
变动(%)	-0.0100	-0.0050	-0.0100	-0.0150	-0.0025
昨日国开债(%)	1.5800	2.2625	2.5675	2.7250	2.8650
今日国开债(%)	1.5800	2.2400	2.5640	2.7100	2.8625
变动(%)	0.0000	-0.0225	-0.0035	-0.0150	-0.0025

短期融资券

今日短融交投情绪活跃，成交主要集中在各期限 AAA AA+短融产品。短端方面，3D 012381817.IB 23 中化股 SCP015 AAA 成交在 2.00% 位置，银行出给基金，85D 012382826.IB 23 东方电气 SCP002(科创票据) AAA 成交在 2.18%位置，银行出给基金；中长端方面，111D 012380654.IB 23 南电 SCP003 AAA 成交在 2.12%位置，银行出给基金，147D 012382454.IB 23 伊利实业 SCP011 AAA 成交在 2.27% 位置，银行出给基金；长端方面，246D 012382570.IB 23 浙交投 SCP008 AAA 成交在 2.36%位置，银行出给基金，341D(休 1) 042380376.IB 23 申能集 CP001 AAA 成交 2.40%位置，银行出给基金；总体而言，今日短融收益震荡。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	2.03		2.16		2.26		2.34		2.38	
	AA+	2.26		2.34		2.51		2.6		2.75	
	AA	2.76		3.02		3.18		3.5		3.76	
	AA-	3.18		3.88		3.99		4.45		4.5	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	2.01	2	2.21	-5	2.29	-3	2.36	-2	2.4	-2
	AA+	2.26	0	2.37	-3	2.55	-4	2.63	-3	2.75	0
	AA	2.76	0	3.06	-4	3.18	0	3.5	0	3.76	0
	AA-	3.18	0	3.88	0	3.99	0	4.45	0	4.5	0

中期票据

今日中票交投情绪较为活跃。1-3 年短端中票，买盘为基金和理财。19 中石油 MTN006 (AAA, 1.21Y) 在 2.415%成交，高估值 1bp 成交；19 汇金 MTN016 (AAA, 1.15Y) 在 2.39%成交，估值附近成交；22 南电 MTN007 (AAA, 12.32Y) 成交在 2.60%，低估值 1bp 成交；3 到 5 年期限，成交较少，22 国开投 MTN001B (AAA, 4.14Y) 在 2.88%成交，估值附近成交；23 中关村集 MTN001B (AAA, 4.61Y) 在 3.25%成交，低估值 1bp 成交。5Y 及以上期限，成交寥寥。总体而言，今日中票收益率震荡。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.38		2.72		2.89		3.15		None	
	AAA	2.56		2.96		3.26		3.37		None	
	AA+	2.75		3.3		3.63		None		None	
	AA	2.93		3.65		3.93		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.4	-2	2.73	-1	2.9	-1	3.15	0	None	None
	AAA	2.56	0	2.97	-1	3.27	-1	3.37	0	None	None

	AA+	2.75	0	3.32	-2	3.63	0	None	None	None	None
	AA	2.93	0	3.66	-1	3.93	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，21 国元 01 AAA 成交在 2.28%，银行卖出，基金买入。19 蛇口 03 AAA 成交在 2.60%，基金卖出，券商买入。22 华电 Y2 AAA 成交在 2.85%。城投方面，21 江北 01 AAA 成交在 2.45%，券商卖出，基金买入。21 诸资 04 AA+ 成交在 2.65%，基金卖出，银行买入。21 汾湖 G2 AA 成交在 2.85%%。长端方面，23 福投 01 AAA 成交在 3.30%。

美元债

整体依旧偏安静，新发信达 CCAMCL 交投活跃，开盘买盘强劲收窄约 10bps，随后带动 AMC 长端买盘出现。城投板块依旧安静，江浙地区义乌，扬州，南京等城投一票难求，山东地区城投仍有卖盘但买盘依旧稀缺。地产版块，碧桂园整体跌 2-3pts。

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
3D	012381817.IB	23 中化股 SCP015	AAA	2.00%
6D	012284374.IB	22 电网 SCP023	AAA	1.95%
8D	012283941.IB	22 南电 SCP015	AAA	1.95%
8D	012283941.IB	22 南电 SCP015	AAA	2.03%
10D	012283935.IB	22 津城建 SCP040	AAA	3.50%
10D	012283935.IB	22 津城建 SCP040	AAA	3.50%
11D(休 2)	042280368.IB	22 云能投 CP004	AAA	3.70%
11D(休 2)	042280368.IB	22 云能投 CP004	AAA	3.70%
13D	012380492.IB	23 海淀国资 SCP001	AAA	2.28%
14D	012380526.IB	23 福建港口 SCP001	AAA	2.20%
16D	012381089.IB	23 国联 SCP008	AAA	2.03%
17D	042280373.IB	22 津城建 CP020	AAA	3.60%
20D	012380621.IB	23 津城建 SCP008	AAA	3.65%
24D	012284088.IB	22 南航股 SCP016	AAA	2.05%
28D	012380770.IB	23 广晟 SCP002	AAA	2.15%
29D	012381972.IB	23 海运集装 SCP002	AAA	2.03%
29D	012380793.IB	23 光大集团 SCP004	AAA	2.03%
31D	012380382.IB	23 华数 SCP001	AAA	2.16%
34D	042280510.IB	22 长电 CP002	AAA	2.01%
35D	072210203.IB	22 国泰君安 CP003	AAA	2.00%
35D	042280413.IB	22 联通 CP001	AAA	2.05%
35D	012382089.IB	23 华电江苏 SCP014	AAA	2.12%
35D	012382089.IB	23 华电江苏 SCP014	AAA	2.12%
35D	012382089.IB	23 华电江苏 SCP014	AAA	2.12%
36D	012380905.IB	23 光大集团 SCP005	AAA	2.05%
38D	012380969.IB	23 中粮 SCP001	AAA	2.05%
38D	012380969.IB	23 中粮 SCP001	AAA	2.05%
42D	012381966.IB	23 电网 SCP007	AAA	2.01%
42D	012381966.IB	23 电网 SCP007	AAA	2.01%
42D	012381966.IB	23 电网 SCP007	AAA	2.01%
42D	012381966.IB	23 电网 SCP007	AAA	2.01%
42D	012381966.IB	23 电网 SCP007	AAA	2.01%
42D	012381024.IB	23 南电 SCP004	AAA	2.01%
44D	012380878.IB	23 中电投 SCP005	AAA	2.01%
45D	012284357.IB	22 南电 SCP016	AAA	2.01%
45D	012284357.IB	22 南电 SCP016	AAA	2.01%
48D	012381123.IB	23 津城建 SCP015	AAA	3.95%
48D	012381123.IB	23 津城建 SCP015	AAA	3.95%
48D	012382716.IB	23 华电股 SCP001	AAA	2.04%
48D	012382716.IB	23 华电股 SCP001	AAA	2.04%
48D	012382716.IB	23 华电股 SCP001	AAA	2.04%
55D	012381242.IB	23 云投 SCP010	AAA	6.33%
56D	012382420.IB	23 东航股 SCP009	AAA	2.05%
57D	012382487.IB	23 深能源 SCP003	AAA	2.05%
58D	012284481.IB	22 太湖新城 SCP009	AAA	2.20%
58D	012382648.IB	23 中兴通讯 SCP062	AAA	2.14%
58D	012382519.IB	23 华能 SCP014	AAA	100 净价
58D	012382651.IB	23 中兴通讯 SCP060	AAA	2.13%
58D	012382755.IB	23 中电路桥 SCP007	AAA	2.16%
58D	012382519.IB	23 华能 SCP014	AAA	100 净价
58D	012382519.IB	23 华能 SCP014	AAA	100 净价
58D	012382519.IB	23 华能 SCP014	AAA	100 净价
68D(休 1)	012380129.IB	23 新郑投资 SCP001	AA+	2.80%
70D	042280444.IB	22 宁波经开 CP001	AA+	2.36%
70D	012380195.IB	23 左海控股 SCP001	AAA	2.25%
80D	012381548.IB	23 首钢股份 SCP001	AAA	2.23%
80D	012382753.IB	23 蒙牛 SCP009	AAA	2.21%
85D	012382826.IB	23 东方电气 SCP002(科创票据)	AAA	2.18%

85D	012382826.IB	23 东方电气 SCP002(科创票据)	AAA	2.18%
85D	012382826.IB	23 东方电气 SCP002(科创票据)	AAA	2.18%
91D	012381676.IB	23 广州金融 SCP001	AAA	2.21%
95D(休 2)	042280490.IB	22 西盛投资 CP002	AA+	2.60%
98D	012380429.IB	23 泰兴城投 SCP003	AA+	2.48%
98D	012380429.IB	23 泰兴城投 SCP003	AA+	2.48%
105D	012380551.IB	23 深投控 SCP001	AAA	2.13%
108D	012381932.IB	23 南航股 SCP004	AAA	2.16%
109D(休 2)	042280506.IB	22 鹰潭国控 CP002	AA	3.05%
111D	012380654.IB	23 南电 SCP003	AAA	2.12%
112D	012300257.IB	23 金开国投 SCP002	AA	2.64%
114D	072310038.IB	23 广发证券 CP003	AAA	2.12%
126D	012380941.IB	23 锡公用 SCP002	AAA	2.27%
133D	042280539.IB	22 镇江交通 CP003	AA+	2.62%
137D(休 2)	012381613.IB	23 津城建 SCP022	AAA	5.38%
143D	012382773.IB	23 新水国资 SCP006	AA+	2.67%
143D	012382773.IB	23 新水国资 SCP006	AA+	2.67%
143D	012382773.IB	23 新水国资 SCP006	AA+	2.67%
146D	012381592.IB	23 未来科技 SCP004	AA	2.65%
146D	012381592.IB	23 未来科技 SCP004	AA	2.65%
147D	012382454.IB	23 伊利实业 SCP011	AAA	2.27%
147D	012382454.IB	23 伊利实业 SCP011	AAA	2.27%
147D	012382559.IB	23 粤海 SCP006	AAA	2.17%
147D	012382559.IB	23 粤海 SCP006	AAA	2.17%
147D	012382559.IB	23 粤海 SCP006	AAA	2.17%
147D	012382454.IB	23 伊利实业 SCP011	AAA	2.27%
174D	012382793.IB	23 渝医药 SCP007	AA+	3.00%
174D	012382839.IB	23 远东租赁 SCP009	AAA	3.57%
203D	042380414.IB	23 津城建 CP010	AAA	6.40%
206D	042380102.IB	23 晋能电力 CP002	AAA	2.46%
217D	012382486.IB	23 创元投资 SCP005	AA+	2.54%
224D	012382251.IB	23 靖江港 SCP003	AA+	2.98%
227D	012382281.IB	23 西安高新 SCP007	AAA	2.72%
236D(休 1)	042380189.IB	23 镇国投 CP001	AA+	2.80%
246D	012382570.IB	23 浙交投 SCP008	AAA	2.36%
246D	012382570.IB	23 浙交投 SCP008	AAA	2.36%
255D	012382680.IB	23 桐昆控股 SCP007	AA+	2.88%
255D	012382680.IB	23 桐昆控股 SCP007	AA+	2.88%
257D(休 1)	012382707.IB	23 知识城 SCP008	AAA	2.49%
263D(休 2)	012382766.IB	23 华发集团 SCP009	AAA	2.64%
263D(休 2)	012382766.IB	23 华发集团 SCP009	AAA	2.64%
263D(休 2)	012382766.IB	23 华发集团 SCP009	AAA	2.64%
264D(休 1)	042380342.IB	23 津城建 CP008	AAA	7.25%
264D(休 1)	012382787.IB	23 南电 SCP012	AAA	2.27%
265D	012382833.IB	23 豫水利 SCP002	AAA	2.46%
265D	012382833.IB	23 豫水利 SCP002	AAA	2.46%
265D	012382833.IB	23 豫水利 SCP002	AAA	2.46%
265D	012382833.IB	23 豫水利 SCP002	AAA	2.46%
265D	012382833.IB	23 豫水利 SCP002	AAA	2.46%
265D	012382827.IB	23 镇国投 SCP002	AA+	100 净价
265D	012382827.IB	23 镇国投 SCP002	AA+	100 净价
341D(休 1)	042380376.IB	23 申能集 CP001	AAA	2.40%
353D	042380408.IB	23 云能投 CP009	AAA	5.00%

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
16D	101800894.IB	18 中建 MTN001	AAA	2.13%
16D	101800900.IB	18 中建 MTN002	AAA	2.15%
23D+NY	102001609.IB	20 中广核 MTN004	AAA	2.34%
34D+NY(休 2)	102001703.IB	20 洪市政 MTN003	AAA	2.44%
34D	101801000.IB	18 汉江国资 MTN004	AAA	2.26%
34D	101801000.IB	18 汉江国资 MTN004	AAA	2.26%
41D+NY(休 2)	102001752.IB	20 晋焦煤 MTN007	AAA	2.44%
44D	102001766.IB	20 宿迁经开 MTN001	AA	2.60%
54D(休 1)	102101928.IB	21 远东租赁 MTN006	AAA	2.50%
67D+NY(休 9)	102001874.IB	20 中建二局 MTN001	AAA	2.50%
90D	102002050.IB	20 苏国信 MTN008	AAA	2.15%
90D	102002050.IB	20 苏国信 MTN008	AAA	2.15%
111D+1.99Y	102002159.IB	20 金融街 MTN002	AAA	2.55%
124D(休 1)	102103169.IB	21 天津轨交 MTN005	AAA	2.66%

128D	102002246.IB	20 粤珠江 MTN003	AAA	2.36%
130D(休 2)	102002265.IB	20 晋江国资 MTN004	AA+	2.55%
142D	101801537.IB	18 衡阳交通 MTN002	AA	2.95%
148D+NY	101801567.IB	18 鲁钢铁 MTN008	AAA	3.10%
159D+2Y	102100009.IB	21 湖州城投 MTN001	AAA	2.38%
159D+2Y	102100009.IB	21 湖州城投 MTN001	AAA	2.38%
168D	101900052.IB	19 华发集团 MTN001	AAA	2.51%
175D	101900109.IB	19 华发集团 MTN002	AAA	2.52%
180D(休 1)	102280237.IB	22 津地铁 MTN001	AAA	2.63%
199D	102280259.IB	22 赣州建投 MTN001	AA+	3.57%
206D	102280314.IB	22 华阳新材 MTN004	AAA	2.55%
207D(休 2)	102100286.IB	21 陕延油 MTN002	AAA	2.34%
218D	131900005.IB	19 蓉城轨交 GN001	AAA	2.38%
220D	101900292.IB	19 首创集 MTN001	AAA	2.43%
220D+2Y(休 1)	102100347.IB	21 川交投 MTN001	AAA	2.40%
230D+NY	102280548.IB	22 京能源 MTN001	AAA	2.54%
231D+2Y	102100496.IB	21 宿迁城投 MTN001	AA+	2.53%
239D	101754025.IB	17 苏州高新 MTN001	AA+	2.55%
244D+1Y	102280703.IB	22 国药租赁 MTN003	AAA	2.68%
251D	102100622.IB	21 鲁黄金 MTN002	AAA	2.45%
259D	102100709.IB	21 苏交通 MTN002	AAA	2.36%
259D	102100692.IB	21 金茂投资 MTN001	AAA	2.80%
265D+1Y	102280891.IB	22 中盐 MTN001	AAA	2.47%
271D(休 1)	102100870.IB	21 江宁科学 MTN001	AA+	2.65%
271D(休 1)	102100870.IB	21 江宁科学 MTN001	AA+	2.65%
281D	101900669.IB	19 顺义国资 MTN001	AA+	2.48%
281D	101900669.IB	19 顺义国资 MTN001	AA+	2.48%
282D	101900688.IB	19 富阳城投 MTN003	AA+	2.53%
292D(休 1)	102281094.IB	22 汇金 MTN002	AAA	2.32%
294D	102100973.IB	21 泰交通 MTN002	AA+	2.60%
313D(休 2)	102101045.IB	21 招金 MTN001	AAA	2.50%
320D(休 1)	102281292.IB	22 汇金 MTN003	AAA	2.33%
322D	102101117.IB	21 光大控股 MTN001	AAA	2.45%
347D(休 2)	132100074.IB	21 中节能 GN002	AAA	2.51%
352D	101900940.IB	19 滁州城投 MTN001	AA+	2.58%
353D	102101322.IB	21 东方电气 MTN002	AAA	2.45%
353D	102101322.IB	21 东方电气 MTN002	AAA	2.45%
357D+2Y	101900980.IB	19 中煤能源 MTN001	AAA	2.52%
1.01Y+NY(休 2)	102281690.IB	22 鲁钢铁 MTN003	AAA	3.35%
1.03Y+NY	102101511.IB	21 洪市政 MTN003	AAA	2.80%
1.05Y(休 1)	102100506.IB	21 潍坊投资 MTN001	AA+	5.50%
1.05Y+NY	102101593.IB	21 中冶 MTN002	AAA	2.73%
1.05Y+NY	102101593.IB	21 中冶 MTN002	AAA	2.73%
1.05Y+NY	102101608.IB	21 中铁建投 MTN002	AAA	2.82%
1.05Y+NY	102101608.IB	21 中铁建投 MTN002	AAA	2.82%
1.13Y(休 2)	102101870.IB	21 苏新国资 MTN005	AA+	2.58%
1.15Y	102101941.IB	21 华电云南 MTN001	AA+	2.75%
1.15Y	101901320.IB	19 汇金 MTN016	AAA	2.39%
1.21Y	101901368.IB	19 蚌埠城投 MTN001	AA+/AA	2.90%
1.23Y	101901411.IB	19 广州金控 MTN001	AAA	2.85%
1.26Y+NY(休 1)	102102207.IB	21 大唐集 MTN007	AAA	2.78%
1.29Y+2Y(休 1)	102102295.IB	21 舟山旅游 MTN001	AA+	2.92%
1.3Y	102103039.IB	21 浦口城乡 MTN003	AA	3.06%
1.33Y+NY	102282600.IB	22 中电投 MTN037	AAA	2.79%
1.36Y+10Y	131900025.IB	19 武汉地铁 GN001	AAA	2.58%
1.47Y	102280177.IB	22 京能电力 MTN001	AAA	2.63%
1.49Y(休 1)	102280209.IB	22 鞍山钢铁 MTN001(可持续挂钩)	AAA	2.81%
1.57Y+NY	102380284.IB	23 赣州发展 MTN001	AAA	3.52%
1.58Y+NY(休 2)	102380353.IB	23 中电投 MTN001(能源保供特别债)	AAA	2.84%
1.58Y+NY(休 2)	102380353.IB	23 中电投 MTN001(能源保供特别债)	AAA	2.84%
1.62Y	102000350.IB	20 洪市政(疫情防控债)MTN001	AAA	2.73%
1.62Y	102000350.IB	20 洪市政(疫情防控债)MTN001	AAA	2.73%
1.63Y	102280552.IB	22 太仓港 MTN001	AA	3.03%
1.65Y+NY	102380692.IB	23 水电五局 MTN001	AA+	3.44%
1.65Y	102280640.IB	22 吉利 MTN001	AAA	3.13%
1.65Y	102280640.IB	22 吉利 MTN001	AAA	3.13%
1.7Y(休 1)	102280759.IB	22 晋能煤业 MTN006	AAA	3.00%
1.7Y(休 1)	102280759.IB	22 晋能煤业 MTN006	AAA	3.00%

1.72Y	102000422.IB	20 赣投 MTN001	AAA	2.71%
1.74Y(休 1)	102280956.IB	22 中建投资 MTN002	AAA	2.86%
1.75Y	102000931.IB	20 溧水经开 MTN002	AA/AAA	2.95%
1.76Y	102281055.IB	22 中化股 MTN002	AAA	2.67%
1.79Y(休 1)	101573007.IB	15 锡城发 MTN001(10 年期)	AAA	2.76%
1.88Y	102281296.IB	22 光大控股 MTN001	AAA	2.84%
1.95Y(休 1)	102381657.IB	23 新乡投资 MTN004	AA+	3.43%
1.97Y	102281599.IB	22 国丰集团 MTN002A	AAA	2.80%
2Y	102001442.IB	20 武侯产业 MTN002	AA+	3.08%
2.01Y	102281716.IB	22 宣城国资 MTN004	AA+	3.03%
2.05Y+NY	102281847.IB	22 中铝 MTN003	AAA	3.05%
2.08Y+2Y	102282004.IB	22 重庆物流 MTN001	AA+	4.73%
2.12Y+NY(休 2)	102282074.IB	22 招商公路 MTN002	AAA	2.95%
2.14Y(休 1)	102282108.IB	22 苏豪 MTN001	AA+	3.20%
2.16Y+NY(休 1)	102282168.IB	22 招商局 MTN003	AAA	2.93%
2.2Y+2Y	102282231.IB	22 金阳新城 MTN003	AA+	4.35%
2.32Y	102282569.IB	22 南电 MTN007	AAA	2.60%
2.38Y	102282737.IB	22 光大集团 MTN003	AAA	2.71%
2.38Y	102282737.IB	22 光大集团 MTN003	AAA	2.71%
2.7Y(休 1)	102380837.IB	23 浙江机场 MTN001	AAA	2.86%
2.73Y(休 1)	102381065.IB	23 中兴国资 MTN002	AA+	4.00%
2.82Y	102381249.IB	23 绿城房产 MTN002	AAA	4.26%
2.98Y+2Y	102381823.IB	23 陕投集团 MTN005(混合型 科创票据)	AAA	3.07%
3.62Y(休 1)	102280503.IB	22 宜昌城发 MTN002	AA+	3.46%
4.14Y	102282127.IB	22 国开投 MTN001B	AAA	2.88%

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
12D(休 1)	2028030.IB	20 兴业银行小微债 05	AAA	2.20%
16D	143751.SH	18 华综 01	AAA	2.24%
16D	188590.SH	国电投 09	AAA	2.02%
19D(休 1)	2028031.IB	20 渤海银行小微债	AAA	2.11%
21D	143621.SH	18 蓝星 02	AAA	2.15%
22D	127906.SH	18 铁道 23	AAA	1.895%
37D+5Y	1828007.IB	18 浦发银行二级 01	AAA	2.23%
37D	167377.SH	20 弘湘 01	AA+	3.00%
39D(休 2)	167570.SH	20 济金 02	AA+	2.80%
48D+5Y	1828009.IB	18 浦发银行二级 02	AAA	2.24%
55D+1.99Y	167737.SH	20 驻投 03	AA+	3.65%
69D+1.97Y	167792.SH	G20 阿地 1	AA+	2.86%
72D	188481.SH	21 招证 G6	AAA	2.10%
76D+NY	175264.SH	20 电建 Y2	AAA	2.30%
82D(休 1)	143868.SH	18 电投 09	AAA	2.20%
83D+3Y	197084.SH	21 新余 03	AA	3.25%
86D+NY	175298.SH	20 延长 Y4	AAA	2.45%
95D(休 2)	1680437.IB	16 淳安养老债	AA	2.72%
100D	1680443.IB	16 锡新城债	AA	2.55%
107D	1680453.IB	16 海安双创债	AA	2.65%
107D+NY	149300.SZ	20DJLQY1	AAA	2.50%
118D+5Y	180217.IB	18 国开 17		2.30%
118D+5Y	180217.IB	18 国开 17		2.30%
118D+5Y	180217.IB	18 国开 17		2.30%
118D+5Y	180217.IB	18 国开 17		2.30%
118D+5Y	180217.IB	18 国开 17		2.30%
122D	197667.SH	21 岚交 02	AA	3.19%
125D+2Y	177305.SH	20 泽洲 02	AA	3.05%
136D	177357.SH	20 天长 02	AA	3.43%
136D	177357.SH	20 天长 02	AA	3.43%
139D+364D	114282.SH	22 兴化 F3	AA	3.20%
162D	112839.SZ	19 越租 01	AAA	2.47%
170D	185251.SH	22 津投 02	AAA	5.97%
180D(休 1)	2122005.IB	21 华夏租赁债 01	AAA	2.29%
188D	2120005.IB	21 北京银行小微债 01	AAA	2.25%
191D+2Y(休 1)	177866.SH	21 秦发 01	AA	3.44%
223D+4Y(休 2)	152773.SH	21 江北 01	AAA	2.45%
230D	175860.SH	21 英大 01	AAA	2.41%
230D	2128007.IB	21 华夏银行 01	AAA	2.25%
231D+5Y	1928004.IB	19 农业银行二级 02	AAA	2.42%
235D(休 2)	149422.SZ	21 国元 01	AAA	2.28%
235D(休 2)	149422.SZ	21 国元 01	AAA	2.28%
237D+5Y(休 1)	1928006.IB	19 工商银行二级 01	AAA	2.43%

252D	175948.SH	21 南方 01	AAA	2.42%
269D+2Y(休 1)	152836.SH	21 湘速 01	AAA	2.39%
269D	151481.SH	19 豫峡 03	AA+	3.22%
279D	155394.SH	19 宏泰债	AAA	2.62%
294D	151559.SH	19 津港 01	AAA	2.89%
305D+1Y(休 1)	115433.SH	23 津投 10	AAA	7.42%
311D	2128020.IB	21 招商银行小微债 02	AAA	2.30%
314D(休 1)	2128023.IB	21 中信银行小微债	AAA	2.30%
315D+2Y	178814.SH	21 江东 03	AA+	2.70%
322D	1480378.IB	14 铁道 06	AAA	2.26%
329D	178933.SH	21 兰溪 01	AA	3.45%
329D	178933.SH	21 兰溪 01	AA	3.45%
346D	112929.SZ	19 蛇口 03	AAA	2.60%
346D+4Y	2180265.IB	21 庆和瑞债 01	AA	2.73%
348D(休 1)	251501.SH	23 枫桥 02	AA	3.25%
350D+2Y	188397.SH	21 鲁能 01	AAA	2.88%
355D(休 1)	188411.SH	21 兴城 G1	AAA	2.54%
355D(休 1)	188411.SH	21 兴城 G1	AAA	2.54%
1Y	188445.SH	21 诸资 04	AA+	2.65%
1Y	188445.SH	21 诸资 04	AA+	2.65%
1.01Y+2Y	133058.SZ	21 榕城 02	AAA	2.61%
1.05Y	151992.SH	19 华发 03	AAA	3.45%
1.05Y	155633.SH	19 豫投 01	AAA	2.62%
1.06Y(休 2)	188604.SH	21 环球 02	AAA	2.90%
1.07Y+5Y	1928022.IB	19 兴业银行二级 01	AAA	2.53%
1.08Y+2Y	197016.SH	G21 临发 1	AA+	3.28%
1.12Y(休 4)	149629.SZ	21 深投 04	AAA	2.47%
1.12Y(休 4)	149629.SZ	21 深投 04	AAA	2.48%
1.16Y+2Y	196909.SH	21 虞开 01	AA+	3.00%
1.21Y	188874.SH	21 华泰 13	AAA	2.45%
1.22Y	162314.SH	19 滨湖 03	AA+	3.03%
1.23Y	143360.SH	17 川发 01	AAA	2.60%
1.28Y(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.45%
1.28Y(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.45%
1.28Y(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.46%
1.29Y+NY	1928032.IB	19 建设银行永续债	AAA	2.69%
1.29Y+NY	1928032.IB	19 建设银行永续债	AAA	2.69%
1.29Y+NY	1928032.IB	19 建设银行永续债	AAA	2.69%
1.29Y(休 2)	188974.SH	21 沪资 03	AAA	2.57%
1.31Y	185010.SH	21 海通 11	AAA	2.49%
1.35Y	2128046.IB	21 浦发银行 02	AAA	2.46%
1.39Y	2120116.IB	21 南京银行 01	AAA	2.50%
1.41Y	185176.SH	21 天风 05	AAA	3.13%
1.58Y(休 2)	2220015.IB	22 华兴银行小微债	AA+	2.78%
1.59Y	149814.SZ	22 万科 01	AAA	3.30%
1.59Y	149814.SZ	22 万科 01	AAA	3.30%
1.61Y+3Y	133445.SZ	23 荆开 G2	AA	5.50%
1.69Y	2220031.IB	22 浙商银行小微债 02	AAA	2.55%
1.74Y	194500.SH	22 临发 02	AA+	3.63%
1.75Y+NY	2028014.IB	20 中国银行永续债 01	AAA	2.82%
1.75Y+NY	2028014.IB	20 中国银行永续债 01	AAA	2.82%
1.76Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.685%
1.76Y	194511.SH	22 天风 03	AAA	3.82%
1.76Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.69%
1.76Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.69%
1.77Y(休 2)	2220037.IB	22 宁波银行 02	AAA	2.55%
1.78Y+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.85%
1.78Y+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.84%
1.8Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.69%
1.8Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.70%
1.8Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.70%
1.8Y+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.70%
1.82Y	185817.SH	22 粤港 K1	AAA	2.68%
1.87Y	2280257.IB	22 吉利债 01	AAA	3.17%
1.94Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.915%
1.94Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.91%
1.94Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.91%
1.94Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.91%
1.94Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.91%
1.97Y(休 1)	163750.SH	20 张江一	AAA	2.735%
2.01Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.81%
2.01Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.81%

2.02Y+5Y	2020043.IB	20 苏州银行二级	AAA	2.90%
2.13Y+5Y	2028034.IB	20 浦发银行二级 03	AAA	2.83%
2.13Y+5Y	2028034.IB	20 浦发银行二级 03	AAA	2.83%
2.14Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.97%
2.14Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	2.97%
2.15Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.80%
2.15Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.80%
2.24Y(休 1)	114011.SH	22 临城 02	AAA	3.58%
2.35Y	114271.SH	22 南投 01	AA	3.85%
2.37Y+NY(休 1)	2028053.IB	20 中国银行永续债 03	AAA	2.99%
2.47Y+5Y	2128002.IB	21 工商银行二级 01	AAA	2.86%
2.47Y+5Y	2128002.IB	21 工商银行二级 01	AAA	2.86%
2.47Y+5Y	2128002.IB	21 工商银行二级 01	AAA	2.86%
2.54Y(休 1)	138879.SH	23 同安 01	AA+	3.36%
2.65Y+2Y	133469.SZ	23 鹿城 01	AA+	3.35%
2.73Y+2Y	115270.SH	23 动能 02	AAA	3.30%
2.73Y(休 1)	222380003.IB	23 兴业银行绿债 01	AAA	2.67%
2.8Y	188128.SH	21 国君 G4	AAA	2.78%
2.82Y+5Y	2120046.IB	21 广州银行二级	AAA	3.28%
2.82Y+5Y	2120046.IB	21 广州银行二级	AAA	3.28%
2.85Y(休 2)	2328017.IB	23 农业银行三农债	AAA	2.665%
2.85Y(休 2)	2328017.IB	23 农业银行三农债	AAA	2.66%
2.85Y	2328018.IB	23 兴业银行绿色金融债 02	AAA	2.68%
2.86Y	2320022.IB	23 杭州银行 01	AAA	2.70%
2.86Y	2320022.IB	23 杭州银行 01	AAA	2.70%
2.87Y+2Y	115508.SH	23 诚通 11	AAA	3.04%
2.9Y	2320025.IB	23 北京银行 01	AAA	2.72%
2.9Y	2320025.IB	23 北京银行 01	AAA	2.72%
2.96Y(休 2)	2320028.IB	23 威海银行绿色债	AAA	2.77%
2.97Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.67%
2.97Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.67%
2.97Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.67%
2.97Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.67%
2.98Y	212380011.IB	23 上海银行债 02	AAA	2.70%
2.99Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.70%
2.99Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.70%
2.99Y	212300003.IB	23 江苏银行债 02	AAA	2.70%
2.99Y	2328020.IB	23 渤海银行 02	AAA	2.75%
3.06Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.99%
3.29Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	3.165%
3.29Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	3.17%
3.47Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	3.20%
3.47Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	3.085%
4.04Y	182411.SH	22 郑建 02	AA+	3.57%
4.08Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	3.295%
4.08Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	3.295%
4.41Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA	3.79%
4.41Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA	3.79%
4.64Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	3.165%
4.76Y(休 2)	2180155.IB	21 雨花城投 01	AA+	3.35%
4.96Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	3.37%
4.96Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	3.36%