



【2024-02-01】

国债

央行公告称，为维护月末流动性平稳，2月1日以利率招标方式开展了430亿元7天期逆回购操作，中标利率为1.8%。Wind数据显示，当日4660亿元逆回购到期，因此单日净回笼4230亿元。

国债方面 267D 230024 1.89；2.53Y 230017 2.1775-2.205；4.7Y 230022 2.28-2.305；6.62Y 230019 2.41-2.425；9.56Y 230018 2.464-2.479。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.8900	2.1850	2.2900	2.4200	2.4750	2.6650
今日国债(%)	1.8900	2.2050	2.2825	2.4250	2.4790	2.6630
变动(%)	0.0000	0.0200	-0.0075	0.0050	0.0040	-0.0020

金融债

金融债方面 106D 230206 1.98-2.00；219D 230211 2.10-2.11；2.61Y 210208 2.315-2.325；4.31Y 230208 2.3625-2.39；6.1Y 200205 2.5275-2.53；9.72Y 230420 2.645-2.655。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	2.0900	2.3100	2.4350	2.6150	2.6500
今日非国开金融债(%)	2.0850	2.3200	2.4400	2.6100	2.6550
变动(%)	-0.0050	0.0100	0.0050	-0.0050	0.0050
昨日国开债(%)	2.1050	2.3150	2.3775	2.5375	2.6290
今日国开债(%)	2.1100	2.3250	2.3900	2.5500	2.6350
变动(%)	0.0050	0.0100	0.0125	0.0125	0.0060

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Q3期限。短端方面，28D 012384318.IB 23鲁高速 SCP008 AAA 在2.4657%成交（估值位置），银行出给基金；49D 072310283.IB 23银河证券 CP009 AAA 在2.33成交（估值+2位置），基金出给基金。中长端方面，100D 012383039.IB 23中铝集 SCP003 AAA 在2.48%成交（估值-8位置），银行出给基金；113D 012383637.IB 23越秀集团 SCP010 AAA 在2.48成交，（估值-5位置），基金出给理财。长端方面，207D 012480324.IB 24国新保理 SCP001 AAA 在2.61%成交（估值位置），银行出给基金；260D 042380596.IB 23云能投 CP013 AAA 在2.68%成交（估值-1位置），基金出给基金。总体而言，短端、中长端和长端收益均略微震荡下行。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	2.4		2.47		2.55		2.61		2.68	
	AA+	2.65		2.67		2.72		2.77		2.8	
	AA	2.75		2.99		3.02		3.32		3.37	
	AA-	3.09		3.66		3.78		4.35		4.48	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	2.4	0	2.53	-6	2.58	-3	2.64	-3	2.68	0
	AA+	2.65	0	2.7	-3	2.74	-2	2.77	0	2.8	0
	AA	2.76	-1	2.99	0	3.04	-2	3.32	0	3.4	-3
	AA-	3.1	-1	3.66	0	3.83	-5	4.35	0	4.49	-1

中期票据

今日中票交投情绪较为活跃。1-3年短端中票，23北控水集 MTN001（AAA，2.14Y）在2.66%成交，低估值2bp成交；22中电建设 MTN001（AAA，1.76Y）在2.67%成交，低估值2bp成交；23华侨城 MTN001（AAA，1.95Y）成交在3.15%，低估值15bp成交；3到5年期限，23陕延油 MTN005B（AAA，4.88Y）在3.05%成交，低估值1bp成交；24光大集团 MTN001（AAA，4.98Y）成交在2.895%，低估值2bp成交。5Y及以上期限，24葛洲坝 MTN001（AAA，9.99Y）成交在2.9%，低估值1bp成交。总体而言，今日中票收益略有下行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.47		2.62		2.79		2.92		Null	
	AAA	2.62		2.7		2.88		Null		Null	
	AA+	2.74		2.92		3.21		Null		Null	
	AA	2.8		3.0		3.5		Null		Null	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.47	0	2.62	0	2.8	-1	2.94	-2	Null	Null
	AAA	2.63	-1	2.71	-1	2.92	-4	Null	Null	Null	Null
	AA+	2.75	-1	2.95	-3	3.25	-4	Null	Null	Null	Null
	AA	2.84	-4	3.04	-4	3.53	-3	Null	Null	Null	Null

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，G22 宝钢 1 AAA 成交在 2.61%，基金卖出，基金买入。23 紫金 K1 AAA 成交在 2.68%。23 扬子 G3 AAA 成交在 2.68%,券商卖出，基金买入。城投方面，22 芜建 02 AA+ 成交在 2.68%。基金卖出，保险买入。22 国惠债 01 AAA 成交在 2.76%，银行卖出，基金买入。24 泰山 G2 AAA 成交在 3.46%。长端方面，21 远发 03 AAA 成交在 2.97%。23 港口 01 AAA 成交在 2.92%。

美元债

美联储 1 月 FOMC 会议后市场整体稳定，投资级版块腾讯 TENCNT 有部分获利了结盘，中航国际租赁 BOCAVI 小幅走阔。城投版块较昨日稍显清淡，买盘依旧集中在 24-26 期限。新发科学城 GZDZCD 25 表现良好价格上涨约 0.5pt，新发青岛华通 QDHTCO 27 表现不佳市场对峙在 99.85/100.05，青岛国信 CONSON 26 今日在 6.35%附近有少量成交。地产版块金辉表现不佳，24s 一度跌至 50 附近，雅居乐 AGILE 25s 在 16 附近有少量卖盘。

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
4D	012381852.IB	23 国电 SCP003	AAA	2.45%
4D	012381852.IB	23 国电 SCP003	AAA	2.45%
4D	012381852.IB	23 国电 SCP003	AAA	2.35%
5D	012384059.IB	23 宁沪高 SCP024	AAA	2.43%
6D	072310236.IB	23 国元证券 CP015	AAA	2.40%
6D	072310071.IB	23 东北证券 CP005	AAA/A-1	2.30%
21D	072310037.IB	23 东北证券 CP003	AAA/A-1	2.40%
22D	042380102.IB	23 晋能电力 CP002	AAA	2.48%
28D	012384318.IB	23 鲁高速 SCP008	AAA	2.47%
28D	012384318.IB	23 鲁高速 SCP008	AAA	2.47%
28D	012384318.IB	23 鲁高速 SCP008	AAA	2.47%
28D	012480037.IB	24 中建八局 SCP001	AAA	2.43%
31D(休 1)	012480287.IB	24 陕有色 SCP001	AAA	2.53%
33D	012382486.IB	23 创元投资 SCP005	AA+	2.60%
39D	012383740.IB	23 京基投 SCP001	AAA	2.40%
42D	012384121.IB	23 苏交通 SCP026	AAA	2.37%
42D	012384121.IB	23 苏交通 SCP026	AAA	2.37%
49D	072310283.IB	23 银河证券 CP009	AAA	2.33%
50D	012384442.IB	23 南通城建 SCP008	AAA	2.46%
50D	012384442.IB	23 南通城建 SCP008	AAA	2.46%
50D	012384442.IB	23 南通城建 SCP008	AAA	2.46%
50D	012384244.IB	23 招商局 SCP009	AAA	2.35%
56D	012480101.IB	24 伊利实业 SCP004	AAA	2.47%
57D	012480151.IB	24 伊利实业 SCP006	AAA	2.47%
57D	012480157.IB	24 中兴通讯 SCP009	AAA	2.47%
57D	012480332.IB	24 中兴通讯 SCP021	AAA	2.47%
57D	012480220.IB	24 中兴通讯 SCP010	AAA	2.47%
62D	012382566.IB	23 大横琴 SCP001	AAA	2.54%
62D	012382566.IB	23 大横琴 SCP001	AAA	2.54%
65D(休 2)	042380338.IB	23 电网 CP002	AAA	2.40%
69D	012383537.IB	23 桐乡城投 SCP003	AA+	2.50%
75D	012384047.IB	23 天成租赁 SCP019	AAA	2.56%
78D	012382768.IB	23 南航集 SCP004	AAA	2.49%
80D(休 1)	012382785.IB	23 宿迁经开 SCP002	AA	2.67%
80D(休 1)	012382785.IB	23 宿迁经开 SCP002	AA	2.67%
84D	042380254.IB	23 云能投 CP005	AAA	2.67%
84D	042380254.IB	23 云能投 CP005	AAA	2.67%
84D	042380254.IB	23 云能投 CP005	AAA	2.67%
86D(休 2)	012384301.IB	23 国新保理 SCP006	AAA	2.62%

89D	012382918.IB	23 知识城 SCP009	AAA	2.55%
100D(休 2)	012383040.IB	23 巨石 SCP005	AAA	2.60%
109D	012383202.IB	23 重庆物流 SCP004	AA+	2.65%
110D	012383240.IB	23 株国投 SCP001	AA+	2.66%
113D	012383637.IB	23 越秀集团 SCP010	AAA	2.48%
136D(休 1)	012383894.IB	23 张江集 SCP005	AAA	2.48%
144D	012480343.IB	24 东南国资 SCP001	AAA	2.53%
146D	042300039.IB	23 商丘发展 CP001	AA+	2.60%
168D	012384176.IB	23 华电租赁 SCP009	AAA	2.58%
169D	012383849.IB	23 西南水泥 SCP003	AAA	100
176D	012383955.IB	23 云投 SCP039	AAA	2.67%
189D	072310164.IB	23 华西证券 CP004	AAA	2.44%
196D	042380454.IB	23 黄石城发 CP002	AA+	2.65%
197D	012384312.IB	23 湘高速 SCP013	AAA	2.50%
207D	012480324.IB	24 国新保理 SCP001	AAA	2.61%
207D	012480324.IB	24 国新保理 SCP001	AAA	2.61%
207D	012480324.IB	24 国新保理 SCP001	AAA	2.61%
252D	042380743.IB	23 桂交投 CP010	AAA	2.62%
260D	042380596.IB	23 云能投 CP013	AAA	2.68%
263D	012480336.IB	24 宿迁水务 SCP002	AA+	2.63%
300D	042380708.IB	23 义乌国资 CP002	AAA	2.54%

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
21D	101900221.IB	19 中油股 MTN004	AAA	2.28%
21D	102100276.IB	21 陕延油 MTN001	AAA	2.38%
21D	102100276.IB	21 陕延油 MTN001	AAA	2.38%
24D(休 1)	102100292.IB	21 南电 MTN001	AAA	2.36%
27D	101900242.IB	19 蒙高路 MTN001	AA+	2.55%
29D	101900255.IB	19 首钢 MTN002	AAA	2.48%
32D+1.99Y	102100312.IB	21 铁建房产 MTN001	AAA	2.98%
71D	101900521.IB	19 宜昌城控 MTN003	AA+	2.62%
71D	101900521.IB	19 宜昌城控 MTN003	AA+	2.62%
132D	101900785.IB	19 十堰城投 MTN001	AA	2.64%
168D	101900936.IB	19 苏交通 MTN003	AAA	2.45%
172D	101900976.IB	19 苏交通 MTN004	AAA	2.45%
193D	102101504.IB	21 光大集团 MTN001A	AAA	2.44%
195D	102382022.IB	23 昆明安居 MTN002	AA+	3.20%
199D(休 1)	102101583.IB	21 营口港 MTN001	AA+/AAA	2.66%
207D	102101690.IB	21 东江环保 MTN001	AA+	2.74%
214D+2Y	102382342.IB	23 平度城投 MTN002	AA+	2.71%
229D(休 1)	102101890.IB	21 南通国投 MTN001	AAA	2.52%
232D	102282103.IB	22 上海大众 MTN002	AAA	2.65%
240D(休 2)	102101975.IB	21 南航股 MTN002	AAA	2.48%
240D(休 2)	102101975.IB	21 南航股 MTN002	AAA	2.48%
259D	102282257.IB	22 云能投 MTN007	AAA	2.68%
277D	102102228.IB	21 张家公资 MTN002	AAA	2.54%
277D	102102228.IB	21 张家公资 MTN002	AAA	2.54%
295D	102103046.IB	21 南航股 MTN003	AAA	2.48%
295D	102103046.IB	21 南航股 MTN003	AAA	2.48%
295D	102103046.IB	21 南航股 MTN003	AAA	2.48%
298D+2Y	102103087.IB	21 首开 MTN005	AAA	2.90%
320D	102103280.IB	21 中远租赁 MTN001	AAA	2.79%
1.05Y	102000128.IB	20 港兴港投 MTN001	AAA	2.80%
1.07Y	132280016.IB	22 融和融资 GN001(碳中和债)	AAA	2.65%
1.07Y	102000175.IB	20 淄博城运 MTN001	AAA/AA+	2.70%
1.07Y	102000175.IB	20 淄博城运 MTN001	AAA/AA+	2.70%
1.1Y(休 2)	102280446.IB	22 厦门市政 MTN001	AAA	2.54%
1.12Y(休 1)	102000356.IB	20 河钢集 MTN002	AAA	2.67%
1.12Y(休 1)	102200121.IB	22 营口港 MTN001	AA+/AAA	2.71%
1.12Y+2Y	102280556.IB	22 广产投 MTN001	AAA	2.85%
1.15Y+NY	102380706.IB	23 中电投 MTN008	AAA	2.61%
1.2Y	102000674.IB	20 吴江交投 MTN001	AA+	2.55%
1.2Y	102000674.IB	20 吴江交投 MTN001	AA+	2.55%
1.23Y	102280932.IB	22 深业 MTN001	AAA	2.58%
1.4Y(休 2)	102281419.IB	22 淮北建投 MTN003	AA+	2.84%
1.44Y(休 1)	102281545.IB	22 沪杭甬 MTN002	AAA	2.55%
1.5Y+1Y	102381917.IB	23 淮北建投 MTN008	AA+	2.81%
1.55Y+NY	102382140.IB	23 中粮置业 MTN001	AAA	2.87%
1.55Y+NY	102382140.IB	23 中粮置业 MTN001	AAA	2.87%

1.55Y+NY	102382140.IB	23 中粮置业 MTN001	AAA	2.87%
1.6Y(休 1)	102382416.IB	23 天津轨交 MTN003	AAA	2.70%
1.64Y	102282150.IB	22 国航 MTN001	AAA	2.52%
1.64Y	102282150.IB	22 国航 MTN001	AAA	2.52%
1.65Y+NY	102382594.IB	23 华侨城 MTN005	AAA	3.50%
1.65Y+NY	102382594.IB	23 华侨城 MTN005	AAA	3.50%
1.7Y	102282240.IB	22 海淀国资 MTN001	AAA	2.76%
1.7Y	102282240.IB	22 海淀国资 MTN001	AAA	2.76%
1.78Y	102383044.IB	23 津城建 MTN011	AAA	3.01%
1.82Y+1Y(休 1)	102383206.IB	23 闽国资 MTN001	AA+	2.70%
1.83Y+NY	102282633.IB	22 赣州发展 MTN003	AAA	2.85%
1.94Y(休 1)	102380042.IB	23 中金集 MTN001	AAA	2.60%
1.98Y	102480328.IB	24 津城建 MTN007	AAA	3.04%
1.98Y	102480328.IB	24 津城建 MTN007	AAA	3.05%
2.07Y	102380325.IB	23 四川振兴 MTN001	AA+	2.70%
2.07Y	102380325.IB	23 四川振兴 MTN001	AA+	2.70%
2.29Y	102381200.IB	23 首创生态 MTN001	AAA	2.74%
2.53Y+NY(休 2)	102382064.IB	23 大唐集 MTN008	AAA	2.71%
2.54Y	102382101.IB	23 内蒙高速 MTN002	AA+	2.90%
2.94Y+2Y	102480086.IB	24 即墨旅投 MTN001	AA+	3.12%
2.96Y	102480183.IB	24 华侨城 MTN001	AAA	3.47%
3.06Y	102280328.IB	22 建发地产 MTN002B(并购)	AAA	3.18%
4.92Y	102480032.IB	24 泰山财金 MTN001B	AA+	3.46%

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
4D+2Y	149376.SZ	21 珠华 01	AAA	3.10%
4D+2Y	149376.SZ	21 珠华 01	AAA	3.10%
41D	151252.SH	19 绵控 01	AA+	2.71%
47D	152129.SH	19 扬子 01	AAA	2.45%
50D+2Y(休 1)	175728.SH	21 金高 01	AA+	2.57%
50D+5Y	1923001.IB	19 中国人寿	AAA	2.50%
52D(休 1)	175890.SH	21 延长 03	AAA	2.52%
55D	111078.SZ	19 新兴 G2	AAA	2.49%
74D	188000.SH	21 建材 01	AAA	2.50%
78D	1780053.IB	17 黄陂城投债	AA/AAA	2.72%
78D	2122018.IB	21 长安汽车债 01	AAA	2.49%
107D(休 2)	2122023.IB	21 江苏租赁债 02	AAA	2.55%
118D	151609.SH	19 武经 03	AA+	2.65%
131D+NY(休 1)	155921.SH	19 大唐 Y4	AAA	2.57%
135D(休 2)	188261.SH	21CHNE01	AAA	2.46%
145D	178633.SH	21 武高 02	AA/AA+	2.86%
160D	143167.SH	17 光控 02	AAA	2.60%
177D(休 2)	188456.SH	21 华安 G2	AAA	2.47%
179D	188458.SH	21 海通 06	AAA	2.42%
186D+1.99Y	188495.SH	21 紫金 03	AAA	2.56%
192D(休 1)	137644.SH	22 津投 21	AAA	2.65%
221D	149626.SZ	21 申证 12	AAA	2.43%
256D+2Y	197221.SH	21 济轨 01	AAA	2.66%
268D(休 2)	197362.SH	21 余创 01	AAA	2.61%
268D(休 2)	197362.SH	21 余创 01	AAA	2.61%
288D+2Y(休 1)	188964.SH	21SIIC02	AAA	2.62%
291D+2Y	185011.SH	21 诚通 19	AAA	2.53%
291D+2Y	185011.SH	21 诚通 19	AAA	2.53%
295D	185010.SH	21 海通 11	AAA	2.44%
332D(休 1)	2080419.IB	20 环天小微债 01	AA/AA+	2.87%
332D(休 1)	2080419.IB	20 环天小微债 01	AA/AA+	2.87%
359D+2Y	2280030.IB	22 焦作投资小微债 01	AA+	2.71%
1.04Y	185364.SH	22 华泰 G1	AAA	2.45%
1.1Y+NY	163938.SH	20 中核 Y4	AAA	2.60%
1.22Y	185700.SH	22 鲁资 02	AAA	2.70%
1.31Y(休 2)	185811.SH	G22 宝钢 1	AAA	2.61%
1.52Y	137625.SH	22 银河 C5	AAA	2.60%
1.52Y	137625.SH	22 银河 C5	AAA	2.60%
1.55Y	137664.SH	22 芜建 02	AA+	2.68%
1.56Y+4Y(休 2)	2280377.IB	22 国惠债 01	AAA	2.76%
1.56Y+4Y(休 2)	2280377.IB	22 国惠债 01	AAA	2.76%
1.57Y	137729.SH	22 华安 G2	AAA	2.57%
1.57Y+3Y	252136.SH	23 曹国 02	AA+	3.25%
1.57Y+3Y	252136.SH	23 曹国 02	AA+	3.25%
1.6Y	137799.SH	22 海通 05	AAA	2.52%

1.61Y	138979.SH	23 招证 C1	AAA	2.60%
1.62Y+1Y	252397.SH	23 周投 03	AA+	3.00%
1.64Y	148068.SZ	22 顺丰 01	AAA	2.69%
1.64Y+2Y	137848.SH	22 兵国 01	AA+	2.85%
1.77Y	138571.SH	22 海通 07	AAA	2.54%
1.79Y(休 1)	240259.SH	23 国君 13	AAA	2.53%
1.88Y+4Y	184646.SH	22 株国债	AA+	2.95%
1.96Y	240504.SH	24 中证 G1	AAA	2.56%
1.99Y	177730.SH	21 上虞 01	AA/AA+	3.03%
2.12Y+2Y	115061.SH	23 动能 01	AAA	2.89%
2.17Y+2Y	115137.SH	23 宏洋 02	AAA	3.18%
2.27Y+2Y	115350.SH	23 紫金 K1	AAA	2.68%
2.28Y	115353.SH	23 中证 G9	AAA	2.58%
2.3Y+2Y	251044.SH	23 昌州 01	AA+	3.07%
2.31Y(休 1)	115403.SH	23 东证 04	AAA	2.60%
2.31Y+2Y	115419.SH	23 陆集 02	AAA	2.87%
2.38Y	115703.SH	23 招证 G8	AAA	2.58%
2.47Y+2Y(休 2)	188444.SH	21 诚通 12	AAA	2.67%
2.47Y+2Y(休 2)	188444.SH	21 诚通 12	AAA	2.67%
2.48Y	115679.SH	23 安信 G1	AAA	2.62%
2.54Y	115813.SH	23 川金 01	AAA	2.75%
2.54Y	115828.SH	23 海通 15	AAA	2.60%
2.56Y+NY	148439.SZ	23 招商局 YK03	AAA	2.70%
2.56Y+2Y	148440.SZ	23 龙建 01	AA+	2.81%
2.62Y+NY	115978.SH	铁工 KY09	AAA	2.66%
2.62Y	115967.SH	23 银河 G5	AAA	2.60%
2.65Y(休 1)	240039.SH	23 扬子 G3	AAA	2.68%
2.72Y	240087.SH	23 扬子 G4	AAA	2.68%
2.81Y+2Y	252715.SH	23 西湖 02	AAA	2.80%
2.95Y+2Y	253614.SH	24 阿地 01	AA+	3.06%
2.97Y+NY	185307.SH	22 中证 Y1	AAA	2.81%
2.97Y+NY	185307.SH	22 中证 Y1	AAA	2.81%
2.97Y	253672.SH	24 盐控 01	AAA	10000.10%
2.98Y	240553.SH	24 国惠 01	AAA	2.84%
3.23Y+NY	185739.SH	22 招证 Y3	AAA	2.83%
3.41Y+NY	149967.SZ	22 广发 Y1	AAA	2.96%
3.44Y+NY	137521.SH	22 国君 Y1	AAA	2.84%
3.56Y+NY	137712.SH	22 信投 Y3	AAA	2.86%
3.56Y+NY	137712.SH	22 信投 Y3	AAA	2.86%
3.56Y+NY	148040.SZ	22 申证 Y2	AAA	2.86%
3.69Y+NY(休 1)	137871.SH	22 中金 Y2	AAA	2.87%
3.72Y+NY	137604.SH	22 华泰 Y3	AAA	2.87%
3.74Y+NY	137957.SH	22 中泰 Y1	AAA	2.97%
4.97Y	240478.SH	24 泰山 G2	AA+	3.46%
5.23Y	091900007.IB	19 长城债 02BC(品种二)	AAA	3.30%
37D+2Y	032100646.IB	21 重庆临空 PPN002	AA+	2.67%
190D	031900613.IB	19 武汉城投 PPN001	AAA	2.56%
207D	032100905.IB	21 丰城发投 PPN001	AA+	2.84%
229D(休 1)	032101043.IB	21 皖投集 PPN002	AAA	2.59%
284D+2Y	032191207.IB	21 鄞通集团 PPN001	AA+	2.70%
294D	031900849.IB	19 沪地产 PPN001	AAA	2.65%
316D+2Y(休 1)	032191433.IB	21 新郑投资 PPN002	AA+	2.83%
359D(休 2)	032280132.IB	22 盐城城资 PPN002	AAA	2.58%
360D+2Y	032280165.IB	22 长寿生态 PPN001	AA	3.60%
360D(休 1)	032380692.IB	23 西安高新 PPN002	AAA	2.80%
360D(休 1)	032380692.IB	23 西安高新 PPN002	AAA	2.80%
365D(休 4)	032480104.IB	24 溧水城建 PPN004	AA+	10000.00%
365D(休 4)	032480104.IB	24 溧水城建 PPN004	AA+	10000.00%
1.14Y	032280334.IB	22 临江投资 PPN001	AA+	2.75%
1.69Y(休 1)	032280850.IB	22 沪城控 PPN001	AAA	2.74%
1.98Y	032480090.IB	24 靖江城投 PPN001	AA	3.00%
46D	2128007.IB	21 华夏银行 01	AAA	2.30%
46D	2128007.IB	21 华夏银行 01	AAA	2.30%
46D	2128007.IB	21 华夏银行 01	AAA	2.30%
46D	2128007.IB	21 华夏银行 01	AAA	2.30%
47D+5Y	1928004.IB	19 农业银行二级 02	AAA	2.43%
52D(休 1)	2128010.IB	21 光大银行小微债	AAA	2.30%
52D(休 1)	2128010.IB	21 光大银行小微债	AAA	2.30%
52D(休 1)	2128010.IB	21 光大银行小微债	AAA	2.30%
52D(休 1)	2128010.IB	21 光大银行小微债	AAA	2.30%
52D(休 1)	2128010.IB	21 光大银行小微债	AAA	2.30%
53D	2128012.IB	21 浦发银行 01	AAA	2.28%

53D+5Y(休 1)	1928006.IB	19 工商银行二级 01	AAA	2.44%
53D	2128012.IB	21 浦发银行 01	AAA	2.28%
70D+5Y	1928009.IB	19 农业银行二级 04	AAA	2.45%
70D+5Y	1928009.IB	19 农业银行二级 04	AAA	2.46%
70D+5Y	1928009.IB	19 农业银行二级 04	AAA	2.46%
130D(休 1)	2128023.IB	21 中信银行小微债	AAA	2.34%
134D+5Y	1921021.IB	19 重庆农商二级	AAA	2.54%
146D+NY	1928014.IB	19 华夏银行永续债	AAA	2.56%
162D+NY	1928016.IB	19 浦发银行永续债	AAA	2.57%
162D+NY	1928016.IB	19 浦发银行永续债	AAA	2.57%
162D+NY	1928016.IB	19 浦发银行永续债	AAA	2.57%
180D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.56%
197D+5Y	1928019.IB	19 交通银行二级 01	AAA	2.48%
197D+5Y	1928019.IB	19 交通银行二级 01	AAA	2.48%
200D+5Y(休 2)	1428011.IB	14 建行二级 01	AAA	2.49%
201D	2120071.IB	21 上海银行	AAA	2.38%
201D+NY	1928021.IB	19 农业银行永续债 01	AAA	2.56%
208D+5Y	1928022.IB	19 兴业银行二级 01	AAA	2.52%
239D+5Y	1920059.IB	19 江苏银行二级	AAA	2.53%
283D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.39%
283D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.39%
283D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.39%
288D+NY	1928032.IB	19 建设银行永续债	AAA	2.58%
288D+NY	1928032.IB	19 建设银行永续债	AAA	2.58%
288D+NY	1928032.IB	19 建设银行永续债	AAA	2.57%
288D+NY	1928032.IB	19 建设银行永续债	AAA	2.58%
288D+NY	1928032.IB	19 建设银行永续债	AAA	2.58%
288D+NY	1928032.IB	19 建设银行永续债	AAA	2.57%
289D(休 2)	2128041.IB	21 广发银行小微债	AAA	2.40%
289D(休 2)	2128041.IB	21 广发银行小微债	AAA	2.40%
289D(休 2)	2128041.IB	21 广发银行小微债	AAA	2.40%
313D	2128048.IB	21 民生银行 02	AAA	2.42%
347D	2220001.IB	22 泉州银行小微债	AA+	2.51%
359D(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	2.41%
359D(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	2.41%
359D(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	2.41%
1.11Y	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	2.40%
1.11Y	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	2.40%
1.11Y	2228020.IB	22 兴业银行 02	AAA	2.40%
1.12Y	2220019.IB	22 南京银行 01	AAA	2.42%
1.12Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.58%
1.12Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.58%
1.12Y+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.58%
1.24Y+NY	2028014.IB	20 中国银行永续债 01	AAA	2.57%
1.26Y	2028016.IB	20 兴业银行小微债 02	AAA	2.42%
1.26Y+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.51%
1.26Y	2028016.IB	20 兴业银行小微债 02	AAA	2.40%
1.27Y+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.58%
1.27Y+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.58%
1.27Y+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.58%
1.53Y+5Y	2028024.IB	20 中信银行二级	AAA	2.56%
1.53Y+5Y	2028024.IB	20 中信银行二级	AAA	2.56%
1.56Y+NY(休 1)	2028032.IB	20 农业银行永续债 02	AAA	2.59%
1.62Y+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.54%
1.62Y+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.54%
1.64Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.53%
1.64Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.54%
1.64Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.54%
1.64Y+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.55%
1.7Y+NY	2028042.IB	20 兴业银行永续债	AAA	2.60%
1.75Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.58%
1.78Y	2228057.IB	22 浦发银行 04	AAA	2.45%
1.78Y	2220078.IB	22 杭州银行债 02	AAA	2.49%
1.78Y	2220078.IB	22 杭州银行债 02	AAA	2.49%
1.81Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.62%
1.81Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.61%
1.81Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.61%
1.81Y+NY(休 1)	2028051.IB	20 浦发银行永续债	AAA	2.61%
1.86Y(休 2)	222280001.IB	22 交行绿债 02	AAA	2.45%
1.87Y(休 1)	2228060.IB	22 建设银行三农债	AAA	2.44%
2.29Y	212380005.IB	23 光大银行债 01	AAA	2.50%
2.29Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	2.66%

2.31Y(休 1)	2320019.IB	23 北京银行小微债 02	AAA	2.50%
2.31Y(休 1)	2320019.IB	23 北京银行小微债 02	AAA	2.50%
2.35Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.66%
2.36Y	2320022.IB	23 杭州银行 01	AAA	2.51%
2.4Y	2320025.IB	23 北京银行 01	AAA	2.51%
2.44Y+NY	2120064.IB	21 恒丰银行永续债	AAA	2.97%
2.44Y+NY	2120064.IB	21 恒丰银行永续债	AAA	2.97%
2.44Y+NY	2120064.IB	21 恒丰银行永续债	AAA	2.97%
2.57Y	2320043.IB	23 杭州银行 02	AAA	2.53%
2.57Y	2320043.IB	23 杭州银行 02	AAA	2.53%
2.57Y	2320043.IB	23 杭州银行 02	AAA	2.53%
2.57Y	2320043.IB	23 杭州银行 02	AAA	2.53%
2.57Y	2320043.IB	23 杭州银行 02	AAA	2.53%
2.61Y(休 1)	2321030.IB	23 北京农商小微债	AAA	2.56%
2.81Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.69%
2.81Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.69%
2.81Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.69%
2.81Y+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	2.68%
2.9Y+NY	2120118.IB	21 广州银行永续债	AAA/AA+	2.84%
2.95Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	2.70%
2.95Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	2.70%
2.96Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	2.72%
2.96Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	2.72%
3.06Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.74%
3.06Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.74%
3.06Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.74%
3.2Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	2.67%
3.37Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.69%
3.37Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.70%
3.38Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	2.69%
3.57Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	2.74%
3.64Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.71%
3.64Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.71%
3.65Y+NY	092280094.IB	22 河北银行永续债 02	AAA/AA+	3.18%
4.32Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.91%
4.58Y+5Y	232380034.IB	23 厦门国际二级资本债 02	AAA	3.06%
4.79Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	2.77%
4.83Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.86%
4.83Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.86%