

常规报告系列

收盘日评

银行间债券市场

NEX

上海国际货币经纪

Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-06-12】

国债

央行公告称，为维护银行体系流动性合理充裕，2024 年 6 月 12 日央行公开市场开展 20 亿元 7 天期逆回购操作，中标利率 1.80%。中国央行公开市场周二逆回购到期 40 亿元，周三到周五各有 20 亿元逆回购到期，均为 7 天期。另外，本周五将首发 350 亿元 50 年期特别国债。本周国债招标规模总计 4490 亿元。

国债方面 232D 240002 1.55； 306D 200005 1.6275； 2.72Y 240003 1.8775-1.8825； 4.36Y 230022 2.0375-2.0475； 6.55Y 230028 2.19-2.195； 9.47Y 230026 2.312-2.315； 28.86Y 230009 2.5515-2.5525。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.5900	1.8750	2.0425	2.1970	2.3040	2.5310
今日国债(%)	1.5900	1.8825	2.0475	2.2020	2.3045	2.5320
变动(%)	0.0000	0.0075	0.0050	0.0050	0.0005	0.0010

金融债

金融债方面 336D 240411 1.775-1.785； 2.72Y 220203 1.9825-1.9975； 4.27Y 230415 2.135-2.1375； 6.73Y 210205 2.265-2.27； 9.26Y 230215 2.39-2.3975。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.7750	2.0075	2.1500	2.2900	2.3930
今日非国开金融债(%)	1.7850	2.0075	2.1600	2.2900	2.3930
变动(%)	0.0100	0.0000	0.0100	0.0000	0.0000
昨日国开债(%)	1.7700	1.9675	2.0950	2.2425	2.3830
今日国开债(%)	1.7750	1.9775	2.1000	2.2500	2.3880
变动(%)	0.0050	0.0100	0.0050	0.0075	0.0050

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 Q3 期限。短端方面，2D 012383482.IB 23 广州地铁 SCP013 AAA 在 1.90%成交（估值+6BP 位置），基金出给银行；28D 012480138.IB 24 中交建 SCP001 AAA 在 1.98%成交（在估值+3BP 位置），银行出给理财。中长端方面，100D 012481783.IB 24 中建三局 SCP007(科创票据) AAA 在 2.05%成交（估值位置），银行出给理财；100D 012480339.IB 24 潞安 SCP001 AAA 在 2.07%成交（估值-3BP 位置），银行出给基金。长端方面，220D(休 2) 012481406.IB 24 鲁钢铁 SCP004 AAA 在 2.14%成交（估值位置），。银行出给券商；264D 012481751.IB 24 山东金融 SCP003 AAA 在 2.13%成交（估值-3BP 位置），银行出给理财。总体而言，短端收益变动上行，中长端和长端收益变动不大。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	1.95		2.015		2.03		2.08		2.11	
	AA+	2.04		2.06		2.12		2.17		2.2	
	AA	2.13		2.2		2.3		2.35		2.38	
	AA-	2.89		3.4		3.4		3.98		4.2	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	1.95	0	2.0	2	2.01	2	2.06	2	2.1	1
	AA+	2.01	3	2.08	-2	2.13	-1	2.18	-1	2.21	-1
	AA	2.12	1	2.2	0	2.3	0	2.34	1	2.39	-1
	AA-	2.87	2	3.42	-2	3.4	0	3.98	0	4.22	-2

中期票据

今日中票交投情绪活跃。1-3 年短端中票，23 华电 MTN005A（AAA，1.02）在 2.13%成交，高估值 2bp 成交；23 中电投 MTN022A（AAA，1.06Y）在 2.13%成交，高估值 2bp 成交；22 招商局 MTN003（AAA，1.3Y）在 2.14%成交，高估值 1bp 成交；3 到 5 年期限，20 久事 MTN003（AAA，3.28Y）在 2.21%成交，高估值 2 bp 成交；23 汇金 MTN006B（AAA，4.38Y）成交在 2.26%，高估值 1bp 成交。5Y 及以上期限，24 北控集 MTN001（AAA，9.75Y）成交在 2.59%，估值价成交。24 三峡新能 MTN002（AAA，9.98Y）成交在 2.62%，估值价成交。总体而言，今日中票收益较前一日有所上升。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.03		2.19		2.31		2.48		None	
	AAA	2.1		2.26		2.43		None		None	
	AA+	2.18		2.34		2.63		None		None	
	AA	2.29		2.49		2.89		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.01	2	2.19	0	2.31	0	2.48	0	None	None
	AAA	2.09	1	2.27	-1	2.43	0	None	None	None	None
	AA+	2.18	0	2.34	0	2.64	-1	None	None	None	None
	AA	2.3	-1	2.5	-1	2.9	-1	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，22 国新 05 AAA 成交在 2.13%。24 沪国 01 AAA 成交在 2.20%，基金卖出，保险买入。陕煤 KY08 AAA 成交在 2.44%，券商卖出，保险买入。城投方面，22 湘新 01 AAA 成交在 2.10%，基金卖出，券商买入。23 临平 03 AAA 成交在 2.32%。23 济建 G2 AAA 成交在 2.36%。长端方面，24 国机 K1 AAA 成交在 2.63%。24 山高 K2 AAA 成交在 2.68%。24 焦煤 K1 AAA 成交在 2.70%。

银行债

今日银行债成交较为活跃，收益率全天震荡。成交以 1-5Y 的大行次级债为主，商金债成交主要分布于股份行和城商行，绿债、小微债更受欢迎。早盘期货高开低走，银行二级首先成交在估值-0.5 附近，随后上行至估值+0.5，而后保持震荡，收盘成交在估值+0.5 附近。商金债今天早盘成交在估值-1 附近，盘中一度下行至估值-2，收盘成交在估值-1 附近。短端方面，20 交通银行二级（343D）在 2.07%率先成交，随后上行至 2.075%，收盘成交在 2.08%（+0.75），银行和券商出给券商和基金。新发 24 华夏银行永续债 01（5Y）早盘在 2.455%成交，随后下行至 2.45%，而后在 2.4525%-2.4575%成交多笔，基金理财和保险出给基金和券商。

美元债

美联储议息会议在即，多数机构观望情绪较重，市场整体清淡，投资级版块稳定较昨日几乎无变化小幅走窄 1-2bps。城投板块买盘多数集中在 1-3 年期限，山东地区国惠，临沂等名字有双向交投，其中临沂 LYURBN 26 在 6.8%附近有成交。地产板块稳定，无较大变化。

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
2D	012383482.IB	23 广州地铁 SCP013	AAA	1.90%
6D	012383559.IB	23 吉利 SCP007	AAA	1.90%
8D	042380334.IB	23 湘高速 CP003	AAA	1.88%
8D	012481180.IB	24 伊利实业 SCP009	AAA	1.85%
14D	012480215.IB	24 海淀国资 SCP003	AAA	1.95%
19D	012480454.IB	24 盐城东方 SCP001	AA+	2.05%
28D	012480138.IB	24 中交建 SCP001	AAA	1.98%
28D	012480138.IB	24 中交建 SCP001	AAA	1.98%
30D	012481617.IB	24 中建八局 SCP009	AAA	2.02%
30D	012481617.IB	24 中建八局 SCP009	AAA	2.02%
30D	012481617.IB	24 中建八局 SCP009	AAA	2.02%
30D	012481556.IB	24 华能 SCP003	AAA	1.95%
30D	012481556.IB	24 华能 SCP003	AAA	1.95%
30D	012481556.IB	24 华能 SCP003	AAA	1.95%
30D	012481175.IB	24 相城城建 SCP002	AA+	2.05%
30D	012480326.IB	24 电网 SCP004	AAA	2.00%
37D	012481319.IB	24 宁沪高 SCP005	AAA	2.01%
37D	012481319.IB	24 宁沪高 SCP005	AAA	2.01%
37D	012481319.IB	24 宁沪高 SCP005	AAA	2.01%

37D	012481319.IB	24 宁沪高 SCP005	AAA	2.01%
49D	012481430.IB	24 夏商 SCP007	AA+	2.08%
49D	012481430.IB	24 夏商 SCP007	AA+	2.08%
49D	012481718.IB	24 华能 SCP005	AAA	1.95%
58D	012481737.IB	24 中建八局 SCP010	AAA	2.00%
58D	012481737.IB	24 中建八局 SCP010	AAA	2.00%
62D	012480801.IB	24 苏国信 SCP005	AAA	1.99%
64D	012481583.IB	24 楚天智能 SCP002	AA+	2.06%
64D	012481583.IB	24 楚天智能 SCP002	AA+	2.06%
64D	012481583.IB	24 楚天智能 SCP002	AA+	2.06%
64D	012481583.IB	24 楚天智能 SCP002	AA+	2.06%
64D	012481583.IB	24 楚天智能 SCP002	AA+	2.06%
69D	012480556.IB	24 亨通 SCP002(科创票据)	AA+	5.30%
72D	012481669.IB	24 大唐发电 SCP002	AAA	1.98%
78D	042380498.IB	23 华宇投资 CP002	AA	2.16%
78D	042380498.IB	23 华宇投资 CP002	AA	2.16%
80D(休 2)	012384352.IB	23 鄂联投 SCP005	AAA	2.09%
85D	012481773.IB	24 四川港投 SCP001	AAA	2.03%
89D	012481792.IB	24 鄂交通 SCP003	AA+	2.06%
100D	012481783.IB	24 中建三局 SCP007(科创票 据)	AAA	2.05%
100D	012480339.IB	24 潞安 SCP001	AAA	2.07%
100D	012480339.IB	24 潞安 SCP001	AAA	2.07%
100D	012480339.IB	24 潞安 SCP001	AAA	2.07%
100D	012480339.IB	24 潞安 SCP001	AAA	2.07%
105D	012480869.IB	24 兴业资产 SCP001	AAA	2.01%
138D	012481744.IB	24 平安租赁 SCP007	AAA	2.04%
141D	012481715.IB	24 苏交通 SCP012	AAA	1.99%
158D(休 1)	042380646.IB	23 溧水城建 CP001	AA+	2.09%
187D	042480162.IB	24 深燃气 CP001	AAA	2.02%
210D	042480007.IB	24 海通恒信 CP001	AAA	2.10%
220D(休 2)	012481406.IB	24 鲁钢铁 SCP004	AAA	2.14%
220D(休 2)	012481406.IB	24 鲁钢铁 SCP004	AAA	2.14%
226D	012481518.IB	24 南昌交投 SCP003	AAA	2.09%
264D	012481751.IB	24 山东金融 SCP003	AAA	2.13%
264D	012481751.IB	24 山东金融 SCP003	AAA	2.13%
2D	012383482.IB	23 广州地铁 SCP013	AAA	1.90%
6D	012383559.IB	23 吉利 SCP007	AAA	1.90%
8D	042380334.IB	23 湘高速 CP003	AAA	1.88%
8D	012481180.IB	24 伊利实业 SCP009	AAA	1.85%
14D	012480215.IB	24 海淀国资 SCP003	AAA	1.95%
19D	012480454.IB	24 盐城东方 SCP001	AA+	2.05%
28D	012480138.IB	24 中交建 SCP001	AAA	1.98%
28D	012480138.IB	24 中交建 SCP001	AAA	1.98%
30D	012481617.IB	24 中建八局 SCP009	AAA	2.02%
30D	012481617.IB	24 中建八局 SCP009	AAA	2.02%
30D	012481617.IB	24 中建八局 SCP009	AAA	2.02%
30D	012481556.IB	24 华能 SCP003	AAA	1.95%
30D	012481556.IB	24 华能 SCP003	AAA	1.95%
30D	012481556.IB	24 华能 SCP003	AAA	1.95%
30D	012481175.IB	24 相城城建 SCP002	AA+	2.05%
30D	012480326.IB	24 电网 SCP004	AAA	2.00%
37D	012481319.IB	24 宁沪高 SCP005	AAA	2.01%
37D	012481319.IB	24 宁沪高 SCP005	AAA	2.01%
37D	012481319.IB	24 宁沪高 SCP005	AAA	2.01%
37D	012481319.IB	24 宁沪高 SCP005	AAA	2.01%
49D	012481430.IB	24 夏商 SCP007	AA+	2.08%
49D	012481430.IB	24 夏商 SCP007	AA+	2.08%
49D	012481718.IB	24 华能 SCP005	AAA	1.95%
58D	012481737.IB	24 中建八局 SCP010	AAA	2.00%
58D	012481737.IB	24 中建八局 SCP010	AAA	2.00%
62D	012480801.IB	24 苏国信 SCP005	AAA	1.99%
64D	012481583.IB	24 楚天智能 SCP002	AA+	2.06%
64D	012481583.IB	24 楚天智能 SCP002	AA+	2.06%
64D	012481583.IB	24 楚天智能 SCP002	AA+	2.06%
64D	012481583.IB	24 楚天智能 SCP002	AA+	2.06%
64D	012481583.IB	24 楚天智能 SCP002	AA+	2.06%
69D	012480556.IB	24 亨通 SCP002(科创票据)	AA+	5.30%
72D	012481669.IB	24 大唐发电 SCP002	AAA	1.98%
78D	042380498.IB	23 华宇投资 CP002	AA	2.16%
78D	042380498.IB	23 华宇投资 CP002	AA	2.16%
80D(休 2)	012384352.IB	23 鄂联投 SCP005	AAA	2.09%

85D	012481773.IB	24 四川港投 SCP001	AAA	2.03%
89D	012481792.IB	24 鄂交通 SCP003	AA+	2.06%
100D	012481783.IB	24 中建三局 SCP007(科创票据)	AAA	2.05%
100D	012480339.IB	24 潞安 SCP001	AAA	2.07%
100D	012480339.IB	24 潞安 SCP001	AAA	2.07%
100D	012480339.IB	24 潞安 SCP001	AAA	2.07%
100D	012480339.IB	24 潞安 SCP001	AAA	2.07%
105D	012480869.IB	24 兴业资产 SCP001	AAA	2.01%
138D	012481744.IB	24 平安租赁 SCP007	AAA	2.04%
141D	012481715.IB	24 苏交通 SCP012	AAA	1.99%
158D(休 1)	042380646.IB	23 溧水城建 CP001	AA+	2.09%
187D	042480162.IB	24 深燃气 CP001	AAA	2.02%
210D	042480007.IB	24 海通恒信 CP001	AAA	2.10%
220D(休 2)	012481406.IB	24 鲁钢铁 SCP004	AAA	2.14%
220D(休 2)	012481406.IB	24 鲁钢铁 SCP004	AAA	2.14%
226D	012481518.IB	24 南昌交投 SCP003	AAA	2.09%
264D	012481751.IB	24 山东金融 SCP003	AAA	2.13%
264D	012481751.IB	24 山东金融 SCP003	AAA	2.13%

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
9D	101900837.IB	19 常德城投 MTN001	AA+	1.96%
58D	101901052.IB	19 日照港 MTN001	AAA	2.09%
62D	102101527.IB	21 首钢 MTN002A	AAA	2.01%
76D	102101707.IB	21 江北新区 MTN004	AAA	2.00%
76D	102101707.IB	21 江北新区 MTN004	AAA	2.00%
82D+2.99Y	102200212.IB	22 大足国资 MTN003	AA	2.20%
82D+2.99Y	102200212.IB	22 大足国资 MTN003	AA	2.20%
90D	102101838.IB	21 鲁黄金 MTN008	AAA	2.02%
98D+1.99Y	102101860.IB	21 越秀集团 MTN002	AAA	2.03%
98D+1.99Y	102101860.IB	21 越秀集团 MTN002	AAA	2.03%
98D+1.99Y	102101860.IB	21 越秀集团 MTN002	AAA	2.03%
100D	131900019.IB	19 重庆轨交 GN001	AAA	2.03%
104D	102101942.IB	21 厦国贸控 MTN007	AAA	2.04%
110D	102102008.IB	21 临沂投资 MTN002(革命老区)	AA+	2.14%
110D	102102008.IB	21 临沂投资 MTN002(革命老区)	AA+	2.14%
122D(休 2)	102102023.IB	21 鲁能源 MTN006	AAA	2.05%
122D(休 2)	102102023.IB	21 鲁能源 MTN006	AAA	2.05%
130D(休 1)	102102084.IB	21 青岛啤酒 MTN001	AAA	2.00%
130D(休 1)	102102084.IB	21 青岛啤酒 MTN001	AAA	2.00%
130D(休 1)	102102084.IB	21 青岛啤酒 MTN001	AAA	2.00%
138D+2Y	102102165.IB	21 诚通控股 MTN006	AAA	2.05%
138D+2Y	102102165.IB	21 诚通控股 MTN006	AAA	2.05%
138D+2Y	102102165.IB	21 诚通控股 MTN006	AAA	2.05%
160D	102103034.IB	21 甬交投 MTN001	AAA	2.04%
187D+2Y	102103262.IB	21 温江兴蓉 MTN002	AA+	2.07%
192D(休 2)	102103261.IB	21 京能源 MTN002(可持续挂钩)	AAA	2.04%
223D	102000104.IB	20 朝阳国资 MTN001	AAA	2.10%
228D+NY(休 1)	102280208.IB	22 鲁黄金 MTN002	AAA	2.14%
251D+2Y	102280288.IB	22 淮南建发 MTN001	AA+	2.14%
279D	102280557.IB	22 萧山交投 MTN001	AA+/AAA	2.12%
292D	102280690.IB	22 长春轨交 MTN001	AA+	2.17%
305D(休 1)	102000647.IB	20 徐州经开 MTN002	AA+	2.12%
312D(休 1)	102280831.IB	22 华电股 MTN002A	AAA	2.01%
340D(休 1)	132280048.IB	22 融和融资 GN002(碳中和债)	AAA	2.08%
342D	102281092.IB	22 国网通信 MTN001	AAA	2.13%
349D	102001081.IB	20 舟山交投 MTN002	AA+	2.12%
349D	102281136.IB	22 闽能源 MTN002	AAA	2.07%
1.14Y+2Y	102200189.IB	22 知识城 MTN006	AAA	2.15%
1.14Y+NY(休 1)	102381919.IB	23 北部湾投 MTN003	AAA	2.26%
1.14Y(休 1)	102281695.IB	22 鲁高速 MTN005	AAA	2.09%
1.18Y+NY	102281804.IB	22 京能源 MTN003	AAA	2.14%
1.2Y	102382233.IB	23 丰城发投 MTN001	AA+	2.21%
1.22Y(休 2)	102281973.IB	22 晋能煤业 MTN022	AAA	2.14%
1.22Y(休 2)	102281973.IB	22 晋能煤业 MTN022	AAA	2.14%
1.22Y(休 2)	102281973.IB	22 晋能煤业 MTN022	AAA	2.14%

1.28Y	102282148.IB	22 闽国资 MTN001	AA+	2.18%
1.37Y	102282348.IB	22 华润资产 MTN003	AAA	2.16%
1.44Y+NY	102383091.IB	23 京能源 MTN003	AAA	2.17%
1.51Y+NY(休 1)	102383350.IB	23 青岛国信 MTN008	AAA	2.30%
1.58Y+2Y	102380043.IB	23 渝江北嘴 MTN001	AA+	2.18%
1.7Y+2Y	102380257.IB	23 国惠投资 MTN001B	AAA	2.20%
1.73Y	102100325.IB	21 嘉善经开 MTN001	AA	2.24%
1.74Y+NY	102380454.IB	23 华能 MTN007(能源保供特别债)	AAA	2.15%
1.76Y	102100444.IB	21 临安城投 MTN001	AA+	2.20%
1.77Y+NY	102480991.IB	24 特变股份 MTN001A	AAA	2.24%
1.78Y	102380677.IB	23 北控 MTN001	AAA	2.18%
1.78Y	102380677.IB	23 北控 MTN001	AAA	2.18%
1.83Y+NY	102481206.IB	24 湘高速 MTN003	AAA	2.24%
1.95Y+NY	102381237.IB	23 华电 MTN004B(能源保供特别债)	AAA	2.15%
2.08Y(休 1)	102381645.IB	23 北控 MTN002	AAA	2.14%
2.12Y(休 1)	102101379.IB	21 兖州煤业 MTN001	AAA	2.19%
2.21Y+2Y	102300456.IB	23 信达投资 MTN003A	AAA	2.81%
2.21Y+2Y	102300456.IB	23 信达投资 MTN003A	AAA	2.81%
2.52Y+5Y	102103289.IB	21 武汉城投 MTN001A	AAA	2.20%
2.64Y+2Y	102480422.IB	24 华发集团 MTN002	AAA	2.58%
2.83Y+2Y	102481457.IB	24 中国水务 MTN001	AA+	2.35%
2.92Y	102481943.IB	24 光大控股 MTN002A	AAA	2.29%
2.96Y+2Y	102482102.IB	24 冀中峰峰 MTN002B	AA+	2.80%
2.98Y+NY	102482153.IB	24 首旅 MTN009A	AAA	2.35%
2.98Y(休 2)	102482163.IB	24 邮政 MTN003	AAA	2.20%
2.98Y(休 2)	102482158.IB	24 津城建 MTN021	AAA	2.50%
4.38Y	102382915.IB	23 汇金 MTN006B	AAA	2.26%
4.76Y	102480901.IB	24 四川机场 MTN003	AAA	2.36%
4.76Y	102480901.IB	24 四川机场 MTN003	AAA	2.36%
4.86Y(休 1)	102481663.IB	24 东方国际 MTN001	AAA	2.40%
4.86Y(休 1)	102481632.IB	24 国联 MTN005	AAA	2.39%
4.86Y	102481693.IB	24 福州古厝 MTN004B	AAA	2.42%
4.87Y	102400734.IB	24 通顺交投 MTN001	AA+	2.67%
4.93Y	102481959.IB	24 大唐发电 MTN004	AAA	2.34%
4.94Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.31%
4.94Y(休 1)	102481965.IB	24 潞安 MTN003	AAA	2.46%
4.94Y(休 1)	102481965.IB	24 潞安 MTN003	AAA	2.46%
4.98Y	102482152.IB	24 东南资产 MTN001	AA+	2.48%
4.99Y	102482210.IB	24 信阳建投 MTN004	AA+	100
9.98Y	102482181.IB	24 三峡新能 MTN002	AAA	2.62%
9.98Y	102482173.IB	24 粤交投 MTN001B	AAA	2.62%
9.98Y	102482173.IB	24 粤交投 MTN001B	AAA	2.62%
19.61Y	102480253.IB	24 诚通控股 MTN003B	AAA	2.92%

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
9D	188282.SH	21 华泰 09	AAA	1.80%
26D+1.99Y	178971.SH	21 饶资 02	AA+	2.49%
30D	188387.SH	21 招证 G5	AAA	1.90%
30D	188387.SH	21 招证 G5	AAA	1.90%
41D	155549.SH	19 财金 01	AAA	2.04%
48D+NY	155903.SH	电投 Y18	AAA	2.035%
54D+1.99Y	188313.SH	21 财资 01	AAA	2.07%
58D	151974.SH	19 宁东 01	AAA	2.07%
65D+2Y(休 1)	196836.SH	21 穗开 V1	AAA	2.05%
79D	188636.SH	21 国联 05	AAA	1.93%
93D+2Y(休 1)	188730.SH	21 穗建 03	AAA	2.03%
99D	240003.SH	23 津投 21	AAA	2.03%
99D	155715.SH	19 建银 06	AAA	1.95%
110D+2Y	188715.SH	21 曹国 04	AA+	2.10%
124D+2Y	133693.SZ	23 昆投 02	AA+	2.90%
127D+2Y(休 2)	252550.SH	23 西金 01	AA/AAA	2.50%
138D+2Y	188916.SH	21 发展 02	AAA	2.00%
139D+NY	155869.SH	19 铁建 Y2	AAA	2.05%
151D(休 1)	188962.SH	21 海通 10	AAA	1.99%
165D(休 1)	185045.SH	21 中证 20	AAA	1.98%
183D	149011.SZ	19 河钢 02	AAA	2.07%
184D+NY	138728.SH	中色 YK01	AAA	2.10%

195D	1922050.IB	19 中银金融债 02	AAA	1.95%
195D	1922050.IB	19 中银金融债 02	AAA	1.95%
198D	149760.SZ	21 东财 05	AAA	1.95%
198D	149760.SZ	21 东财 05	AAA	1.95%
211D+NY	2080006.IB	20 济宁城投可转债	AA+	2.31%
211D	253558.SH	24 新余 D1	AA	2.25%
211D	253558.SH	24 新余 D1	AA	2.25%
214D+1Y	138813.SH	23 国金 01	AAA	2.09%
226D+2Y(休 1)	185288.SH	22 招金 01	AAA	2.11%
229D+2Y	196336.SH	22 实创 01	AA+	2.20%
229D+2Y	196336.SH	22 实创 01	AA+	2.20%
273D	163260.SH	20 海国 02	AAA	2.11%
293D+5Y	2023005.IB	20 平安人寿	AAA	2.12%
293D+5Y	2023005.IB	20 平安人寿	AAA	2.12%
306D+NY	185631.SH	22 中咨 Y1	AA+/AAA	2.13%
310D	185676.SH	22 华数 01	AAA	2.12%
317D+NY	185705.SH	22HDGJY1	AAA	2.10%
346D(休 2)	254838.SH	24 国新 D3	AAA	2.16%
352D+1Y(休 2)	133532.SZ	23 株资 V2	AA+	2.23%
352D+1Y(休 2)	133532.SZ	23 株资 V2	AA+	2.23%
352D+1Y(休 2)	133532.SZ	23 株资 V2	AA+	2.23%
1.01Y+2Y	185897.SH	22 台州 01	AAA	2.08%
1.03Y(休 1)	152502.SH	20 厦轨 02	AAA	2.07%
1.12Y(休 2)	137555.SH	22 海通 04	AAA	2.05%
1.16Y+2Y	137633.SH	22 湘新 01	AAA	2.10%
1.18Y+4Y	137641.SH	22 宜兴 02	AA+	2.15%
1.19Y	182430.SH	22 中泰 F2	AAA	2.04%
1.19Y	133289.SZ	22 淮发 02	AAA	2.17%
1.77Y	250424.SH	23 吴发 01	AA+	2.22%
1.88Y	152851.SH	21 蓉高 G1	AAA	2.16%
1.96Y	178613.SH	21 虞水 01	AA/AA+	2.37%
2Y	178760.SH	21 悦来 02	AA+	2.29%
2.12Y+6Y(休 2)	115678.SH	23 洋河 01	AAA	2.19%
2.19Y	1624021.IB	16 荆门管廊项目债	AA	2.27%
2.19Y	115850.SH	23 五资 02	AAA	2.23%
2.45Y+2Y	253105.SH	23 川港 02	AA+	2.34%
2.46Y(休 2)	240341.SH	23 华鑫 02	AA+	2.27%
2.64Y	253823.SH	24 弘湘 01	AA+	2.42%
2.73Y(休 1)	240626.SH	24 沪国 01	AAA	2.20%
2.79Y+2Y	148675.SZ	24 财信 01	AAA	2.26%
2.79Y+2Y	148675.SZ	24 财信 01	AAA	2.26%
2.84Y	152414.SH	20 昆高新	AA+	2.23%
2.84Y+2Y	240867.SH	24 浦集 01	AAA	2.18%
2.87Y(休 2)	152463.SH	20 天源债	AA/AAA	2.42%
2.96Y	2422028.IB	24 招银金租债 02	AAA	2.21%
2.96Y	240669.SH	24 京投 K1	AAA	2.18%
2.96Y	240669.SH	24 京投 K1	AAA	2.18%
2.96Y	240669.SH	24 京投 K1	AAA	2.18%
3.02Y(休 2)	2080140.IB	20 公安城投绿色债	AA-/AAA	2.60%
3.27Y(休 1)	182709.SH	22 淄博 04	AAA	2.40%
3.83Y	143565.SH	18 京投 04	AAA	2.22%
3.84Y	250638.SH	23 温城 01	AAA	2.30%
3.87Y+2Y	148269.SZ	23 金街 02	AAA	2.80%
3.99Y+NY	115461.SH	23 银河 Y2	AAA	2.35%
4.73Y	240638.SH	24 青信 08	AAA	2.47%
4.77Y	133792.SZ	24 淄金 K1	AA+	3.17%
4.94Y	254767.SH	24 保控 02	AA+	2.70%
4.95Y+NY	241037.SH	陕煤 KY08	AAA	2.44%
4.96Y(休 1)	240995.SH	24 长水 01	AA+	2.47%
4.96Y(休 1)	254808.SH	24 芝罘 02	AA+	2.59%
7.97Y+NY	185859.SH	国新 YK02	AAA	2.72%
12D+2Y	032100690.IB	21 海盐国资 PPN003	AA+	2.11%
41D	032100788.IB	21 嵊州城投 PPN002	AA+	2.14%
79D	032100942.IB	21 昆山高新 PPN002	AA+	2.10%
144D(休 1)	032191195.IB	21 新天投资 PPN002	AA	2.28%
166D+1.99Y	032191317.IB	21 埭桥城投 PPN001	AA/AAA	2.23%
274D+1Y	032370200.IB	23 仙桃城投 PPN002	AA	2.28%
310D	032280416.IB	22 鄂州城投 PPN002	AA	2.35%
364D	032000519.IB	20 衡阳城投 PPN003	AA+	2.21%
364D	032000519.IB	20 衡阳城投 PPN003	AA+	2.21%
1.12Y(休 1)	032280671.IB	22 金隆控股 PPN001	AA+	2.33%
1.78Y(休 1)	032380259.IB	23 临平开投 PPN002	AA+	2.25%

2.56Y(休 1)	032400571.IB	24 新航建设 PPN001	AA	2.40%
2.97Y	032480494.IB	24 淮安交通 PPN001	AA+	2.38%
30D+NY	1928016.IB	19 浦发银行永续债	AAA	2.00%
48D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.02%
48D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.02%
48D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.02%
48D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.02%
48D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.02%
69D+NY	1928021.IB	19 农业银行永续债 01	AAA	2.015%
69D+NY	1928021.IB	19 农业银行永续债 01	AAA	2.015%
76D+5Y	1928022.IB	19 兴业银行二级 01	AAA	2.025%
85D+NY	1928023.IB	19 农业银行永续债 02	AAA	2.02%
85D+NY	1928023.IB	19 农业银行永续债 02	AAA	2.015%
92D+5Y	1921030.IB	19 深圳农商二级 01	AAA/AA+	2.06%
99D+5Y	1928026.IB	19 兴业银行二级 02	AAA	2.02%
104D+5Y	1928028.IB	19 中国银行二级 01	AAA	2.01%
107D+NY	1928031.IB	19 广发银行永续债	AAA	2.03%
174D+NY	1920076.IB	19 徽商银行永续债	AAA	2.08%
182D+NY	1928036.IB	19 中信银行永续债	AAA	2.06%
194D	2120116.IB	21 南京银行 01	AAA	1.93%
258D+NY	2028003.IB	20 平安银行永续债 01	AAA	2.105%
279D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.09%
279D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.09%
279D	2220024.IB	22 江苏银行小微债	AAA	2.02%
293D+NY	2020016.IB	20 江苏银行永续债	AAA	2.13%
322D+NY	2028014.IB	20 中国银行永续债 01	AAA	2.095%
322D+NY	2028014.IB	20 中国银行永续债 01	AAA	2.095%
328D+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.075%
328D+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.07%
328D+5Y	2028013.IB	20 农业银行二级 01	AAA	2.07%
334D+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.095%
334D+NY	2028017.IB	20 农业银行永续债 01	AAA	2.095%
343D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.08%
343D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.08%
343D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.075%
343D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.075%
343D+5Y	2028018.IB	20 交通银行二级	AAA	2.075%
1.01Y	2228037.IB	22 交通银行小微债 01	AAA	1.96%
1.01Y	2228037.IB	22 交通银行小微债 01	AAA	1.96%
1.01Y	2228037.IB	22 交通银行小微债 01	AAA	1.96%
1.01Y	2228037.IB	22 交通银行小微债 01	AAA	1.96%
1.2Y+NY(休 1)	2028032.IB	20 农业银行永续债 02	AAA	2.10%
1.27Y+5Y	2028034.IB	20 浦发银行二级 03	AAA	2.10%
1.27Y+5Y	2028034.IB	20 浦发银行二级 03	AAA	2.10%
1.27Y+5Y	2028034.IB	20 浦发银行二级 03	AAA	2.10%
1.3Y+5Y(休 2)	2020065.IB	20 徽商银行二级 01	AAA	2.14%
1.34Y+NY	2028042.IB	20 兴业银行永续债	AAA	2.11%
1.35Y(休 1)	2228051.IB	22 平安银行小微债	AAA	2.00%
1.35Y(休 1)	2228051.IB	22 平安银行小微债	AAA	2.00%
1.42Y	2220078.IB	22 杭州银行债 02	AAA	2.04%
1.44Y	2220079.IB	22 江苏银行	AAA	2.04%
1.45Y+NY	2028052.IB	20 恒丰银行永续债	AAA	2.18%
1.48Y+5Y	2020080.IB	20 长沙银行二级	AAA/AA+	2.165%
1.61Y+5Y	2128002.IB	21 工商银行二级 01	AAA	2.10%
1.61Y+5Y	2128002.IB	21 工商银行二级 01	AAA	2.10%
1.61Y+5Y	2128002.IB	21 工商银行二级 01	AAA	2.10%
1.79Y(休 1)	2328006.IB	23 交通银行小微债 01	AAA	2.03%
1.84Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	2.05%
1.84Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	2.05%
1.84Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	2.05%
1.85Y	2320015.IB	23 宁波银行 01	AAA	2.07%
1.87Y(休 1)	222380003.IB	23 兴业银行绿债 01	AAA	2.00%
1.99Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.17%
1.99Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.17%
2.1Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.07%
2.1Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.07%
2.1Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.07%
2.1Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.07%
2.1Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.07%
2.1Y	212380008.IB	23 交行债 01	AAA	2.07%
2.13Y	2320034.IB	23 北京银行 02	AAA	2.105%
2.41Y(休 2)	2328023.IB	23 浙商银行小微债 02	AAA	2.11%

2.46Y+NY	2128044.IB	21 工商银行永续债 02	AAA	2.20%
2.62Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.185%
2.7Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.23%
2.7Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.23%
2.7Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.23%
2.7Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.23%
2.7Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	2.23%
2.71Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	2.20%
2.71Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	2.20%
2.77Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	2.125%
2.77Y(休 1)	2420013.IB	24 北京银行 01	AAA	2.15%
2.77Y(休 1)	2420013.IB	24 北京银行 01	AAA	2.15%
2.93Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.1925%
2.94Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.1925%
2.95Y	2420019.IB	24 徽商银行 01	AAA	2.17%
2.96Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	2.16%
2.96Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	2.16%
2.96Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	2.16%
2.96Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	2.16%
2.96Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	2.16%
2.98Y	2421003.IB	24 张家港农商小微债	AA+	2.27%
2.98Y	2421003.IB	24 张家港农商小微债	AA+	2.27%
2.98Y	2421003.IB	24 张家港农商小微债	AA+	2.27%
3.01Y+NY	2228038.IB	22 民生银行永续债 01	AAA	2.38%
3.23Y+NY(休 1)	092280086.IB	22 农行永续债 02	AAA	2.275%
3.28Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.245%
3.28Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.245%
3.28Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.245%
3.28Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.245%
3.28Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.245%
3.28Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.245%
3.28Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.245%
3.28Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.245%
3.28Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.245%
3.41Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.26%
3.41Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.255%
3.41Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.255%
3.41Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.255%
3.41Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.255%
3.43Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.255%
3.55Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.32%
4.2Y+5Y	232380032.IB	23 华兴银行二级资本债 01	AA+/AA	3.66%
4.52Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	2.35%
4.65Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.335%
4.65Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.33%
4.65Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.33%
4.76Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.41%
4.76Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.405%
4.83Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AAA	2.3375%
4.87Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.42%
4.87Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.42%
4.87Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.42%
4.88Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.50%
4.88Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.50%
4.88Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.50%
4.88Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.50%
4.88Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.50%
4.88Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.50%
4.88Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.50%
4.88Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.50%
4.88Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.50%
4.9Y+5Y(休 2)	232400016.IB	24 江南农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.50%
4.9Y+5Y(休 2)	232400016.IB	24 江南农商行二级资本债 01	AAA/AA+	2.50%
4.94Y+1Y	312410002.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.30%
4.94Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.395%
4.94Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.39%
4.94Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.3875%
4.98Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.4575%
4.98Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.4525%
4.98Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.4525%
4.98Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.4525%
4.98Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.4575%
4.98Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.4575%
4.98Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.4225%
4.98Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.43%
4.98Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.42%
4.98Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.4225%

4.98Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.4225%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.4575%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.4575%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.4575%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.4525%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.4525%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.4525%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.4525%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.4525%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.4525%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.45%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.45%
5Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.45%
7.16Y+5Y(休 1)	2128026.IB	21 建设银行二级 02	AAA	2.44%
7.2Y+5Y(休 2)	2128029.IB	21 邮储银行二级 02	AAA	2.445%
7.2Y+5Y(休 2)	2128029.IB	21 邮储银行二级 02	AAA	2.445%
7.41Y+5Y(休 1)	2128034.IB	21 建设银行二级 04	AAA	2.445%
7.51Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.445%
7.51Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.445%
9.26Y+5Y	232380053.IB	23 农行二级资本债 02B	AAA	2.49%
9.36Y+5Y(休 2)	232380067.IB	23 中行二级资本债 03B	AAA	2.49%
9.37Y+5Y	232380070.IB	23 建行二级资本债 02B	AAA	2.49%
9.39Y+5Y(休 1)	232380074.IB	23 农行二级资本债 03B	AAA	2.4925%
9.39Y+5Y(休 1)	232380074.IB	23 农行二级资本债 03B	AAA	2.495%
9.65Y+5Y(休 2)	232480007.IB	24 建行二级资本债 01B	AAA	2.495%

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