



【2024-05-28】

国债

今日央行开展 20 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金零投放零回笼。

国债方面 242D 240002 1.61； 316D 200005 1.665； 3.16Y 220016 2.01； 4.38Y 230022 2.083-2.0975； 6.58Y 230028 2.235-2.25； 9.5Y 230026 2.315-2.33； 28.88Y 230009 2.5675-2.59。

	1	2	3	4	5	6
昨日国债(%)	1.6475	1.9500	2.0950	2.2475	2.3050	2.5625
今日国债(%)	1.6450	1.9400	2.0800	2.2375	2.2960	2.5470
变动(%)	-0.0025	-0.0100	-0.0150	-0.0100	-0.0090	-0.0155

金融债

金融债方面 102D 230211 1.72； 239D 240301 1.79； 2.75Y 220203 2.03-2.0325； 4.3Y 230415 2.19-2.1925； 6.76Y 210205 2.3375-2.34； 9.29Y 230215 2.425-2.435。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.8100	2.0675	2.2100	2.3400	2.4400
今日非国开金融债(%)	1.8100	2.0600	2.1975	2.3400	2.4325
变动(%)	0.0000	-0.0075	-0.0125	0.0000	-0.0075
昨日国开债(%)	1.7950	2.0300	2.1425	2.3150	2.4040
今日国开债(%)	1.8000	2.0250	2.1325	2.3050	2.3970
变动(%)	0.0050	-0.0050	-0.0100	-0.0100	-0.0070

短期融资券

今日银行间短融市场交投较为平淡，成交主要集中于 Q3 期限。短端方面，23D 012481009.IB 24 万华化学 SCP004(科创票据) AAA 在 1.95%成交（估值位置），基金出给基金；66D 012384038.IB 23 浙小商 SCP005 AAA 在 2.03%成交（估值-2 位置），基金出给基金。中长端方面，144D(休 2) 042480228.IB 24 扬城建 CP001 AAA 在 2.14%成交（估值+1 位置），银行出给券商；156D 042480005.IB 24 桂交投 CP001 AAA 在 2.13%成交（估值-5 位置），基金出给基金。长端方面，234D 012481449.IB 24 浙交投 SCP008 AAA 在 2.07%成交（估值+4 位置），银行出给基金；347D(休 2) 042480259.IB 24 贵州高速 CP001 AAA 在 2.23%成交，估值-2 位置，银行出给保险。总体而言，短端、中长端和长端收益均呈下行。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	1.96		2		2.09		2.15		2.18	
	AA+	2.15		2.15		2.19		2.19		2.23	
	AA	2.38		2.35		2.45		2.45		2.49	
	AA-	2.9		3.48		3.4		3.98		4.2	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	1.9	6	2	0	2.04	5	2.13	2	2.15	3
	AA+	2.06	9	2.18	-3	2.2	-1	2.24	-5	2.32	-9
	AA	2.4	-2	2.32	3	2.4	5	2.44	1	2.48	1
	AA-	2.94	-4	3.45	3	3.48	-8	4	-2	4.18	2

中期票据

今日中票交投情绪继续平淡。1-3 年短端中票，22 中粮 MTN003（AAA，1.15Y+NY）在 2.14%估值位置成交；23 汇金 MTN003（AAA，1.99Y）在 2.15%估值位置成交；24 光大控股 MTN002A（AAA，2.96Y）在 2.40%成交，低估值 1bp 成交；3 到 5 年期限，23 北控水集 MTN001B（AAA，3.82Y）在 2.39%成交，低估值 4bp 成交；20 久事 MTN003（AAA，3.32Y）成交在 2.29%，低估值 1bp 成交。5Y 及以上期限，21 光大集团 MTN001B（AAA，7.21Y）成交在 2.60%，低估值 3bp。总体而言，今日中票收益震荡，较前一日略有下降。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.03		2.25		2.39		2.58		None	
	AAA	2.15		2.35		2.52		None		None	
	AA+	2.23		2.42		2.73		None		None	
	AA	2.37		2.63		2.98		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.05	-2	2.26	-1	2.4	-1	2.59	-1	None	None
	AAA	2.16	-1	2.36	-1	2.54	-2	None	None	None	None
	AA+	2.25	-2	2.44	-2	2.74	-1	None	None	None	None
	AA	2.38	-1	2.65	-2	3	-2	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 兴业 01 AAA 成交在 2.09%。22 光大 Y3 AAA 成交在 2.32%。23 银河 G9 AAA 成交在 2.36%，保险卖出，银行理财买入。城投方面，22 藏投 01 AA+ 成交在 2.13%，基金卖出，基金买入。21 江北 01 AAA 成交在 2.20%。24 弘湘 02 AA+ 成交在 2.55%，银行理财卖出，银行理财买入。长端方面，22 信投 G3 AAA 成交在 2.62%。24 中化 05 AAA 成交在 2.72%。24 济建 G1 AAA 成交在 2.94%。

银行债

今日银行债交投继续保持相对活跃，全天 TKN 为主，成交主要集中于 2-5Y 大行二永，浙商、兴业等股份行也有较多成交，2-3Y 普通商金债亦成交多量。今日受国债期货上升的影响，收益下行。早盘，2Y 银行二级首先有估值-2 附近成交，后下行至-2.5 附近，之后基本稳定在-2.5 附近。商金早盘多在估值-1 位置成交，午后下降至估值-1.5 位置成交，并基本保持，新发 3Y24 中行 TLAC 非资本债 01A/24 工行 TLAC 非资本债 01A 在票面 2.25 位置多次成交，银行出给基金、理财和券商，交投活跃。3-5Y 期限，22 中行二级资本债 02A (3.41Y) 成交于 2.31% (-2)、2.305% (-2.5) 位置，券商、券商资管和基金出给券商资管、保险和银行。2-3Y 期限，21 工商银行永续债 01 (2.03Y) 于 2.23% (-1)、2.22% (-2)、2.225 (-1.5) 位置陆续成交，券商资管、券商和保险卖出，理财和券商买入。24 北京银行 03 (2.99Y) 在 2.25 (-1) 位置成交多笔，后下行至 100 净价位置成交多笔，主要为银行卖出，基金、券商买入。

美元债

投资版块中化 HAOHUA 早盘活跃，29/30s 等长期限整体开盘走阔 3-4bps，其余无较大波动。城投板块美元债整体单边买盘，山东地区有部分 24s 短券卖盘流出，山高速永续有买盘追高 20c，在 100.75-100.85 位置有多笔成交。地产版块稳定，新城 FUTLAN 25 等在 76 位置有成交。

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	012384369.IB	23 浙能源 SCP006	AAA	1.95%
3D	012384369.IB	23 浙能源 SCP006	AAA	1.95%
16D	012480224.IB	24 蒙牛 SCP003	AAA	1.90%
23D	012481009.IB	24 万华化学 SCP004(科创票据)	AAA	1.95%
23D	012481180.IB	24 伊利实业 SCP009	AAA	1.95%
29D	012480215.IB	24 海淀国资 SCP003	AAA	1.97%
31D	042380352.IB	23 桂投资 CP003	AAA	2.00%
39D(休 2)	042380370.IB	23 潍坊水务 CP004	AA+	3.05%
43D	012480075.IB	24 厦国贸控 SCP003	AAA	2.05%
45D	012383757.IB	23 桂交投 SCP004	AAA	2.11%
49D	072410011.IB	24 红塔证券 CP001	AAA	1.94%
50D	012480325.IB	24 国网租赁 SCP001	AAA	2.03%
66D	012384038.IB	23 浙小商 SCP005	AAA	2.03%
69D	012384053.IB	23 泰交通 SCP001	AA+	2.08%
80D	012480845.IB	24 苏州高新 SCP012	AAA	2.03%
85D	012384490.IB	23 北部湾 SCP001	AAA	2.07%
85D	012384490.IB	23 北部湾 SCP001	AAA	2.07%
91D	012384326.IB	23 申能股 SCP001	AAA	2.02%
92D	042380495.IB	23 武清国资 CP004	AA+	2.14%
94D	012480684.IB	24 泰州城建 SCP005	AAA	2.06%
98D	012480726.IB	24 海安经开 SCP001	AA	2.15%
117D(休 1)	012481067.IB	24 金坛国发 SCP001	AA+	2.16%

117D(休 1)	012481067.IB	24 金坛国发 SCP001	AA+	2.16%
144D(休 2)	042480228.IB	24 扬城建 CP001	AAA	2.14%
144D(休 2)	042480228.IB	24 扬城建 CP001	AAA	2.14%
147D	072410057.IB	24 东财证券 CP005	AAA	2.00%
156D	042480005.IB	24 桂交投 CP001	AAA	2.10%
156D	042480005.IB	24 桂交投 CP001	AAA	2.10%
156D	042480005.IB	24 桂交投 CP001	AAA	2.10%
156D	042480005.IB	24 桂交投 CP001	AAA	2.13%
175D	072410071.IB	24 东财证券 CP006	AAA	2.00%
234D	012481449.IB	24 浙交投 SCP008	AAA	2.07%
234D	012481449.IB	24 浙交投 SCP008	AAA	2.07%
234D	012481449.IB	24 浙交投 SCP008	AAA	2.07%
263D(休 2)	012481609.IB	24 鄂长投 SCP003	AAA	2.16%
347D(休 2)	042480259.IB	24 贵州高速 CP001	AAA	2.23%
347D(休 2)	042480259.IB	24 贵州高速 CP001	AAA	2.23%
347D(休 2)	042480259.IB	24 贵州高速 CP001	AAA	2.23%

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
26D(休 1)	102281366.IB	22 万华化学 MTN001(转型科创)	AAA	1.97%
52D	101900948.IB	19 萧山环境 MTN001	AA+	2.09%
68D(休 1)	102101450.IB	21 金外滩 MTN001	AAA	2.11%
69D	102101465.IB	21 昆明轨道 MTN001(绿色)	AAA	2.32%
84D	101901091.IB	19 合肥产投 MTN001	AAA	2.09%
87D+2Y(休 1)	102101621.IB	21 宜春城投 MTN002	AA	2.00%
88D(休 2)	102101649.IB	21 先行控股 MTN002	AA+	2.10%
119D+2Y	102101934.IB	21 扬州经开 MTN001	AA+/AAA	2.04%
167D+NY(休 2)	102102269.IB	21 首创 MTN002	AAA	2.19%
167D+NY(休 2)	102102269.IB	21 首创 MTN002	AAA	2.19%
174D+2Y	102103022.IB	21 椒江国资 MTN001	AA+	2.14%
174D+NY(休 1)	102102329.IB	21 中建四局 MTN002	AAA	2.27%
179D(休 2)	102103062.IB	21 国新控股 MTN003	AAA	2.06%
192D+2Y(休 1)	102180064.IB	21 蔡甸城建 MTN002	AA	2.22%
197D	101901684.IB	19 鄂交投 MTN005	AAA	2.07%
197D	101901684.IB	19 鄂交投 MTN005	AAA	2.07%
269D	132000002.IB	20 蓉城轨交 GN001	AAA	2.03%
285D(休 1)	102000268.IB	20 嘉公路 MTN001	AA+	2.15%
296D	102000425.IB	20 青岛国信 MTN003	AAA	2.17%
320D(休 1)	102380863.IB	23 鲁宏桥 MTN002	AA+	2.35%
335D	102281000.IB	22 安庆城投 MTN001	AA+	2.16%
345D+1Y	102381132.IB	23 黄石国资 MTN003	AA	2.28%
364D	102281137.IB	22 中海企业 MTN003A	AAA	2.18%
1.04Y	102001153.IB	20 光大绿环 MTN001	AAA	2.18%
1.05Y	102281291.IB	22 中交建 MTN001	AAA	2.09%
1.32Y+NY(休 2)	102300477.IB	23 金隅 MTN004	AAA	2.24%
1.33Y(休 2)	102382630.IB	23 镇江城建 MTN007	AA+	2.30%
1.48Y+NY	102383107.IB	23 金隅 MTN006	AAA	2.25%
1.54Y+2Y(休 1)	102282693.IB	22 金牛环境 MTN002	AA+	2.25%
1.56Y	102282737.IB	22 光大集团 MTN003	AAA	2.12%
1.74Y(休 1)	102380253.IB	23 今世缘 MTN001	AA+	2.30%
1.87Y+NY	102380805.IB	23 华侨城 MTN002B	AAA	4.00%
1.89Y	102480181.IB	24 云天化 MTN001(科创票据)	AA+	2.59%
1.89Y(休 2)	102380938.IB	23 中电投 MTN011	AAA	2.145%
1.89Y(休 2)	102380938.IB	23 中电投 MTN011	AAA	2.145%
1.9Y	102380924.IB	23 鲲鹏投资 MTN001	AAA	2.24%
1.9Y	102380924.IB	23 鲲鹏投资 MTN001	AAA	2.25%
1.95Y	102381142.IB	23 南昌建投 MTN004	AAA	2.23%
1.99Y(休 1)	102381224.IB	23 汇金 MTN003	AAA	2.15%
2.16Y+2Y	102381823.IB	23 陕投集团 MTN005(混合型科创票据)	AAA	2.277%
2.16Y	102381859.IB	23 保利置业 MTN002	AAA	2.70%
2.18Y	102381911.IB	23 南京地铁 MTN001	AAA	2.22%
2.18Y	102381911.IB	23 南京地铁 MTN001	AAA	2.22%
2.28Y(休 1)	102101806.IB	21 徐州新盛 MTN006	AAA	2.35%
2.47Y	102102331.IB	21 保利发展 MTN004	AAA	2.50%
2.53Y	102383262.IB	23 中铁开投 MTN001	AAA	2.40%
2.55Y+2Y	102383354.IB	23 首开 MTN008	AAA	3.37%
2.62Y+2Y	102480045.IB	24 光大水务 MTN001	AAA	2.31%
2.76Y(休 1)	102480628.IB	24 创鸿资产 MTN001	AA+	2.50%

2.76Y(休 1)	102480588.IB	24 瀚瑞投资 MTN002	AA+	2.55%
2.81Y+NY(休 1)	102481022.IB	24 中化股 MTN002	AAA	2.36%
2.89Y+NY	102481623.IB	24 华发集团 MTN007	AAA	3.05%
2.9Y	102280830.IB	22 鄂联投 MTN003B	AAA	2.40%
2.91Y(休 2)	102481707.IB	24 淄博城运 MTN002A	AAA	2.44%
2.95Y+2Y	102400748.IB	24 宁经开 MTN002A	AA+	2.51%
2.95Y+2Y	102400748.IB	24 宁经开 MTN002A	AA+	2.51%
2.97Y	102400752.IB	24 邮政 MTN001	AAA	2.27%
2.99Y+NY	102482020.IB	24 新兴际华 MTN001	AAA	2.39%
2.99Y+2Y	102482043.IB	24 莫干山 MTN003	AA+	2.40%
2.99Y+NY	102400760.IB	24 河钢集 MTN007	AAA	2.6030%
3.42Y	102282392.IB	22 南电 MTN005	AAA	2.29%
3.77Y	102380394.IB	23 华为 MTN003	AAA	2.415%
4.79Y(休 1)	102480787.IB	24 大横琴 MTN004A	AAA	2.56%
4.79Y(休 1)	102480805.IB	24 闽能源 MTN001	AAA	2.43%
4.81Y	102400679.IB	24 延安城投 MTN002	AA+	3.33%
4.82Y(休 1)	102481114.IB	24 南电 MTN003	AAA	2.38%
4.82Y(休 1)	102481114.IB	24 南电 MTN003	AAA	2.38%
4.82Y(休 1)	102400693.IB	24 曲文投 MTN001B	AA+	4.86%
4.89Y+NY	102481587.IB	24 陕延油 MTN007	AAA	2.53%
4.92Y(休 1)	102481858.IB	24 蜀道投资 MTN008	AAA	2.46%
4.92Y(休 1)	102481858.IB	24 蜀道投资 MTN008	AAA	2.46%
4.96Y(休 1)	102481944.IB	24 光大控股 MTN002B	AAA	2.53%
4.97Y	102481950.IB	24 中铁股 MTN001A	AAA	2.40%
4.98Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.39%
4.99Y+NY	102482001.IB	24 中电投 MTN006B	AAA	2.525%
4.99Y	102481999.IB	24 皖能股 MTN001	AAA	2.48%
4.99Y	102481999.IB	24 皖能股 MTN001	AAA	2.48%
4.99Y	102481999.IB	24 皖能股 MTN001	AAA	2.48%
4.99Y	102482034.IB	24 粤电发 MTN001	AAA	2.44%
4.99Y	102482034.IB	24 粤电发 MTN001	AAA	2.44%
7.9Y	102280869.IB	22 锡产业 MTN002	AAA	2.78%
8.21Y	102281771.IB	22 无锡建投 MTN002	AAA	2.78%
9.16Y(休 1)	102381780.IB	23 诚通控股 MTN002B	AAA	2.80%
9.16Y(休 1)	102381780.IB	23 诚通控股 MTN002B	AAA	2.80%
9.91Y	102481767.IB	24 先正达 MTN001B	AAA	2.90%
9.91Y	102481767.IB	24 先正达 MTN001B	AAA	2.90%
9.99Y	102482011.IB	24 诚通控股 MTN013A	AAA	2.85%
9.99Y	102482011.IB	24 诚通控股 MTN013A	AAA	2.8530%

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
2D+5Y	1920039.IB	19 杭州银行二级	AAA	1.87%
10D	2121024.IB	21 重庆农商绿色金融债 01	AAA	1.85%
45D+NY	1928016.IB	19 浦发银行永续债	AAA	2.00%
61D(休 1)	2128024.IB	21 中国银行 02	AAA	1.96%
63D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.01%
63D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.01%
63D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.01%
63D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.02%
63D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	2.02%
84D+NY	1928021.IB	19 农业银行永续债 01	AAA	2.03%
100D+NY	1928023.IB	19 农业银行永续债 02	AAA	2.03%
100D+NY	1928023.IB	19 农业银行永续债 02	AAA	2.03%
114D+5Y	1928026.IB	19 兴业银行二级 02	AAA	2.02%
114D+5Y	1928026.IB	19 兴业银行二级 02	AAA	2.02%
119D+5Y	1928028.IB	19 中国银行二级 01	AAA	2.01%
171D+NY	1928032.IB	19 建设银行永续债	AAA	2.04%
277D(休 2)	2228015.IB	22 浦发银行 03	AAA	2.08%
294D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.125%
317D+NY	2021012.IB	20 深圳农商永续债	AAA/AA+	2.18%
337D+NY	2028014.IB	20 中国银行永续债 01	AAA	2.13%
337D+NY	2028014.IB	20 中国银行永续债 01	AAA	2.13%
1.09Y+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	2.16%
1.12Y+NY	2028023.IB	20 招商银行永续债 01	AAA	2.14%
1.18Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.14%
1.18Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.14%
1.18Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.14%
1.24Y+NY(休 1)	2028032.IB	20 农业银行永续债 02	AAA	2.145%
1.31Y+5Y	2028034.IB	20 浦发银行二级 03	AAA	2.16%

1.32Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.145%
1.32Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.145%
1.33Y+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.155%
1.33Y+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.16%
1.44Y+5Y(休 1)	2028044.IB	20 广发银行二级 01	AAA	2.15%
1.52Y	2228059.IB	22 渤海银行 01	AAA	2.20%
1.65Y+5Y	2128002.IB	21 工商银行二级 01	AAA	2.17%
1.88Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	2.14%
1.88Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	2.14%
1.88Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	2.14%
1.88Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	2.14%
1.91Y+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	2.22%
1.98Y+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	2.22%
2.02Y	212300002.IB	23 江苏银行债 01	AAA	2.16%
2.03Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.225%
2.03Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.22%
2.03Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.22%
2.03Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.23%
2.04Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.22%
2.04Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.225%
2.04Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.24%
2.2Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.195%
2.2Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.20%
2.24Y+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	2.21%
2.29Y	2321028.IB	23 中山农商 01	AA+	2.295%
2.29Y	2321028.IB	23 中山农商 01	AA+	2.30%
2.41Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	2.23%
2.5Y	212380027.IB	23 华夏银行债 05	AAA	2.19%
2.66Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.23%
2.66Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.24%
2.75Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	2.24%
2.75Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	2.24%
2.75Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	2.24%
2.76Y	212480001.IB	24 建行债 01A	AAA	2.185%
2.81Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	2.205%
2.81Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	2.21%
2.81Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	2.21%
2.81Y	2420011.IB	24 浙商银行小微债 01	AAA	2.245%
2.88Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	2.245%
2.88Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	2.245%
2.91Y(休 1)	212400004.IB	24 光大银行小微债	AAA	2.21%
2.97Y	212480011.IB	24 浙商银行小微债 03	AAA	2.245%
2.97Y	212480011.IB	24 浙商银行小微债 03	AAA	2.245%
2.97Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.25%
2.97Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.25%
2.97Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.25%
2.98Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.25%
2.98Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.25%
2.98Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.25%
2.99Y(休 1)	2420018.IB	24 北京银行 03	AAA	100
2.99Y(休 1)	2420018.IB	24 北京银行 03	AAA	100
2.99Y(休 1)	2420018.IB	24 北京银行 03	AAA	100
2.99Y(休 1)	2420018.IB	24 北京银行 03	AAA	100
2.99Y(休 1)	2420018.IB	24 北京银行 03	AAA	100
2.99Y(休 1)	2420018.IB	24 北京银行 03	AAA	100
2.99Y(休 1)	2420018.IB	24 北京银行 03	AAA	2.25%
2.99Y	2420019.IB	24 徽商银行 01	AAA	2.25%
2.99Y	2420019.IB	24 徽商银行 01	AAA	2.25%
2.99Y	2420019.IB	24 徽商银行 01	AAA	2.25%
3Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	2.215%
3Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	2.215%
3Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	2.24%
3Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	2.24%
3Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	2.24%
3.05Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.265%
3.05Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	2.27%
3.25Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	2.315%
3.25Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	2.32%
3.25Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	2.33%
3.27Y+NY(休 1)	092280086.IB	22 农行永续债 02	AAA	2.32%
3.32Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.30%
23D	155473.SH	19 华电 03	AAA	1.90%

47D(休 1)	185993.SH	22 阳安 02	AA+	2.80%
52D	188403.SH	21 中化 01	AAA	2.00%
84D	152255.SH	19 浙资 01	AAA	2.01%
84D	162007.SH	19 淮建 01	AA+	2.15%
90D+3Y	133291.SZ	22 文蓝 02	AA+	3.00%
90D+NY(休 1)	2180335.IB	21 鄂交投可续期 01	AAA	2.13%
90D+NY(休 1)	2180335.IB	21 鄂交投可续期 01	AAA	2.13%
97D+2.99Y	182589.SH	22 潍滨 02	AA+	3.60%
109D(休 4)	188753.SH	国电投 12	AAA	2.09%
151D(休 2)	188924.SH	21 南网 04	AAA	2.05%
153D	155784.SH	19 义乌 01	AAA	2.06%
153D	155784.SH	19 义乌 01	AAA	2.06%
161D	137129.SH	21 方大 EB	AA+	107.81
167D+6.99Y(休 1)	184113.SH	21 西海 01	AAA	2.10%
168D+2Y	133117.SZ	21 海交 01	AA+	2.20%
172D(休 2)	197511.SH	21 郑地 06	AAA	2.21%
186D(休 2)	253116.SH	23 金坛 D3	AA+	2.25%
199D	133382.SZ	22 高控 02	AAA	2.22%
201D(休 1)	114413.SH	22 开封 03	AA/AA+	2.50%
223D	114638.SH	23 吴江 01	AAA	2.18%
227D	152384.SH	G20 广铁 1	AAA	2.03%
228D+2Y	185187.SH	22 藏投 01	AA+	2.13%
228D+2Y	185187.SH	22 藏投 01	AA+	2.13%
234D	149781.SZ	22 长江 01	AAA	2.06%
236D(休 1)	149785.SZ	22 赣水 01	AAA	2.09%
291D(休 2)	185496.SH	22 兴杭 01	AAA	2.15%
291D(休 2)	185496.SH	22 兴杭 01	AAA	2.15%
299D(休 1)	250471.SH	23 洛建 05	AA+	2.25%
303D+2Y(休 2)	166313.SH	20 锡建 02	AAA	2.18%
303D+2Y(休 2)	166313.SH	20 锡建 02	AAA	2.18%
308D+5Y	2023005.IB	20 平安人寿	AAA	2.17%
308D+5Y	2023005.IB	20 平安人寿	AAA	2.17%
315D	185269.SH	22 兴业 01	AAA	2.09%
317D+1Y	115031.SH	23 航租 01	AAA	2.14%
318D+1Y(休 2)	250695.SH	23 天风 01	AAA	2.23%
318D	254336.SH	24 淮交 D1	AA+	2.30%
327D(休 1)	152458.SH	G20 宁铁 1	AAA	2.07%
331D	250791.SH	23 萍发 01	AA+	2.46%
334D(休 1)	185725.SH	22 中泰 03	AAA	2.10%
342D(休 1)	185742.SH	22 华创 C1	AAA	2.18%
1.02Y	163600.SH	20 浦土 01	AA+/AAA	2.17%
1.06Y	163664.SH	20 宏泰 02	AAA	2.22%
1.07Y(休 1)	149956.SZ	22 蛇口 03	AAA	2.24%
1.14Y+2Y(休 1)	137539.SH	22 张江二	AAA	2.11%
1.22Y	2222006.IB	22 中银金融债 01	AAA	2.14%
1.22Y+2Y	148002.SZ	22 华录 01	AA/AA+	3.42%
1.26Y+2Y	182497.SH	22 张店 01	AA+	2.70%
1.32Y(休 2)	137843.SH	22 首钢 01	AAA	2.18%
1.33Y+1Y(休 2)	252462.SH	23 信阳 03	AA+	2.40%
1.41Y+3Y	252542.SH	23 青莱 02	AA+	2.63%
1.43Y(休 2)	138512.SH	22 上金 02	AAA	2.25%
1.49Y+3Y	240278.SH	23 山钢 06	AAA	2.28%
1.56Y+4Y	2280496.IB	22 株洲国投债	AA+	2.40%
1.68Y+5Y(休 2)	2123002.IB	21 建信人寿 01	AAA	2.23%
1.68Y+5Y(休 2)	2123002.IB	21 建信人寿 01	AAA	2.23%
1.68Y+5Y(休 2)	2123002.IB	21 建信人寿 01	AAA	2.23%
1.72Y(休 1)	138890.SH	23 国君 G4	AAA	2.16%
1.79Y	133440.SZ	23 榕城 02	AAA	2.27%
1.99Y	188152.SH	21 安租 06	AAA	2.60%
1.99Y	188152.SH	21 安租 06	AAA	2.60%
1.99Y	188152.SH	21 安租 06	AAA	2.60%
1.99Y+2Y	115396.SH	23 西城 02	AA+	2.25%
2.03Y(休 1)	149497.SZ	21 蛇口 03	AAA	2.31%
2.12Y+2Y	148360.SZ	23 川投 K1	AAA	2.23%
2.15Y	127446.SH	16 穗城 02	AAA	2.23%
2.15Y	127446.SH	16 穗城 02	AAA	2.23%
2.26Y(休 1)	252173.SH	23 沐东 03	AA	2.80%
2.31Y	127456.SH	16 穗港 02	AAA	2.22%
2.41Y(休 2)	136790.SH	16 东航 02	AAA	2.26%
2.45Y	148498.SZ	23 山证 C4	AAA	2.34%
2.49Y	240315.SH	23 青城 11	AAA	2.35%
2.53Y+5Y(休 2)	2123019.IB	21 太平人寿	AAA	2.27%

2.53Y	240390.SH	23 上金 K2	AAA	2.34%
2.56Y+NY(休 2)	240433.SH	河钢 YK10	AAA	2.50%
2.63Y+2Y	196153.SH	22 锡公 02	AAA	2.32%
2.63Y	148567.SZ	24 广发 C1	AAA	2.33%
2.77Y	254048.SH	24 瓯江 01	AA	2.49%
2.9Y	149887.SZ	22 润置 02	AAA	2.47%
2.91Y(休 1)	254658.SH	24 昆城 01	AAA	100
2.94Y	254678.SH	24 弘湘 02	AA+	2.55%
3.77Y	250088.SH	23 两江 02	AAA	2.35%
4.14Y	148383.SZ	23 蛇口 02	AAA	2.59%
4.55Y	240371.SH	23 银河 G9	AAA	2.36%
11.23Y(休 1)	1580205.IB	15 铁道 10	AAA	2.55%
11.23Y(休 1)	1580205.IB	15 铁道 10	AAA	2.56%
119D	032101060.IB	21 余杭创新 PPN005	AAA	2.10%
124D(休 1)	032101092.IB	21 邗江城建 PPN002	AA+	2.20%
167D+2Y	032191207.IB	21 鄞通集团 PPN001	AA+	2.18%
234D	032380086.IB	23 连云港 PPN002	AA+	2.35%
272D+3Y	032380151.IB	23 衡阳城投 PPN001A	AA+	2.20%
285D(休 1)	032280256.IB	22 宁河西 PPN001	AAA	2.18%
296D	032000246.IB	20 运城城投 PPN001	AA+/AAA	2.32%
328D	032380390.IB	23 合川城投 PPN002	AA+	2.40%
1.16Y+3Y	032380592.IB	23 随州城建 PPN001	AA	2.40%
1.55Y	032381234.IB	23 西安高新 PPN005	AAA	2.37%
1.98Y	032480476.IB	24 中建租上 PPN001	AA+	100
2.52Y	032001016.IB	20 天恒置业 PPN007	AA+	2.57%
2.8Y	032480241.IB	24 泰兴城投 PPN005	AA+	2.50%
2.9Y+2Y(休 1)	032480416.IB	24 南阳产投 PPN001	AA+	2.60%
4.77Y	032480218.IB	24 重庆科城 PPN002B	AA+	2.98%
3.41Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	2.295%
3.45Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	2.295%
3.45Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	2.295%
3.45Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	2.30%
3.45Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	2.30%
3.47Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.305%
3.47Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.31%
3.47Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	2.31%
3.82Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	2.34%
3.87Y+5Y	232380014.IB	23 天津银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.74%
3.87Y+5Y	232380014.IB	23 天津银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.74%
3.87Y+5Y	232380014.IB	23 天津银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.74%
3.87Y+5Y	232380014.IB	23 天津银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.74%
3.87Y+5Y	232380014.IB	23 天津银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.74%
4Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.45%
4.05Y+NY	242380008.IB	23 中行永续债 01	AAA	2.435%
4.05Y+NY	242380008.IB	23 中行永续债 01	AAA	2.44%
4.05Y+NY	242380008.IB	23 中行永续债 01	AAA	2.44%
4.05Y+NY	242380008.IB	23 中行永续债 01	AAA	2.44%
4.05Y+NY	242380008.IB	23 中行永续债 01	AAA	2.46%
4.14Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	2.45%
4.14Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	2.45%
4.25Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.455%
4.25Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.46%
4.25Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.46%
4.25Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.46%
4.25Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.47%
4.25Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.47%
4.25Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.48%
4.32Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	2.40%
4.39Y+NY	242380019.IB	23 邮储永续债 01	AAA	2.46%
4.39Y+NY	242380019.IB	23 邮储永续债 01	AAA	2.48%
4.43Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA	2.41%
4.43Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA	2.42%
4.51Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.48%
4.51Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.48%
4.51Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.48%
4.51Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.48%
4.51Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.49%
4.51Y+NY	242380033.IB	23 招行永续债 01	AAA	2.49%
4.68Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	2.425%
4.68Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	2.425%
4.7Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.42%

4.7Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.43%
4.7Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.43%
4.8Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.475%
4.8Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.475%
4.8Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.475%
4.8Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.475%
4.8Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.48%
4.81Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.49%
4.82Y+5Y(休 2)	1928007.IB	19 工商银行二级 02	AAA	2.425%
4.82Y+5Y(休 2)	1928007.IB	19 工商银行二级 02	AAA	2.425%
4.86Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.425%
4.86Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.425%
4.86Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.435%
4.87Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AAA	2.435%
4.87Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AAA	2.435%
4.89Y+5Y	232480010.IB	24 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.5075%
4.91Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.43%
4.91Y+5Y	1928012.IB	19 工商银行二级 04	AAA	2.43%
4.91Y+5Y	1928012.IB	19 工商银行二级 04	AAA	2.43%
4.91Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.495%
4.91Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.495%
4.91Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.50%
4.91Y+5Y	1928012.IB	19 工商银行二级 04	AAA	2.44%
4.91Y+5Y	1928012.IB	19 工商银行二级 04	AAA	2.44%
4.92Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.43%
4.92Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.43%
4.92Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.43%
4.92Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.58%
4.96Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA	2.49%
4.96Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA	2.4925%
4.96Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA	2.4925%
4.96Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA	2.4925%
4.96Y+5Y	232400018.IB	24 宁波银行二级资本债 01	AAA	2.4925%
4.98Y+1Y	312410002.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.36%
4.98Y+1Y	312410002.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.36%
4.98Y+1Y	312410002.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.36%
4.98Y+1Y	312410002.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.36%
4.98Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.465%
4.98Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.48%
6.81Y+5Y	2128009.IB	21 中国银行二级 02	AAA	2.58%
6.81Y+5Y	2128009.IB	21 中国银行二级 02	AAA	2.59%
6.81Y+5Y	2128009.IB	21 中国银行二级 02	AAA	2.59%
6.81Y+5Y	2128009.IB	21 中国银行二级 02	AAA	2.59%
6.81Y+5Y	2128009.IB	21 中国银行二级 02	AAA	2.59%
9.41Y+5Y(休 2)	232380067.IB	23 中行二级资本债 03B	AAA	2.65%
9.41Y+5Y(休 2)	232380067.IB	23 中行二级资本债 03B	AAA	2.65%
9.41Y+5Y(休 2)	232380067.IB	23 中行二级资本债 03B	AAA	2.65%
9.41Y+5Y(休 2)	232380067.IB	23 中行二级资本债 03B	AAA	2.655%
9.41Y+5Y(休 2)	232380067.IB	23 中行二级资本债 03B	AAA	2.655%
9.47Y+5Y	232380079.IB	23 交行二级资本债 01B	AAA	2.65%
9.69Y+5Y(休 2)	232480007.IB	24 建行二级资本债 01B	AAA	2.65%

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:
以上所提及增加的所有信息 (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