



【2024-10-30】

国债

央行公告称，为维护月末银行体系流动性合理充裕，10月30日以固定利率、数量招标方式开展了4310亿元7天期逆回购操作，操作利率为1.5%。Wind数据显示，当日7927亿元逆回购到期，据此计算，单日净回笼3617亿元。

国债方面 268D 240015 1.38-1.385； 2.79Y 240016 1.58-1.595； 4.71Y 240014 1.815-1.82； 6.65Y 240013 2.025-2.0375； 9.57Y 240011 2.1325-2.14； 28.96Y 230023 2.316-2.3375。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1.3700	1.5975	1.8150	2.0375	2.1400	2.3450
今日国债(%)	1.3800	1.5800	1.8200	2.0325	2.1400	2.3350
变动(%)	0.0100	-0.0175	0.0050	-0.0050	0.0000	-0.0100

金融债

金融债方面 268D 240421 1.72-1.725； 4.32Y 240203 1.885-1.905； 5.97Y 200215 2.08-2.085； 9.68Y 240420 2.265-2.2725。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.7200	1.8450	1.9400	2.1100	2.2725
今日非国开金融债(%)	1.7100	1.8500	1.9400	2.1000	2.2750
变动(%)	-0.0100	0.0050	0.0000	-0.0100	0.0025
昨日国开债(%)	1.7150	1.8200	1.8975	2.1400	2.2260
今日国开债(%)	1.7200	1.8150	1.9050	2.1400	2.2250
变动(%)	0.0050	-0.0050	0.0075	0.0000	-0.0010

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Q4期限。短端方面，55D 012481153.IB 24知识城 SCP001 AAA 在2.04%成交（估值-2位置），基金出给基金；85D 012481502.IB 24粤珠江 SCP002 AAA 在2.30%成交（估值-1位置），基金出给基金。中长端方面，146D 042480168.IB 24晋江产投 CP002 AA+ 在2.38%成交（估值位置），资管出给基金；167D 012483319.IB 24拱墅国投 SCP004 AA+ 在2.24%成交（估值+3位置），银行出给基金。长端方面，219D 072410083.IB 24东兴证券 CP001 AAA 在1.99%成交（估值-2位置），基金出给理财；294D 042480489.IB 24电网 CP021 AAA 在2.00%成交，估值位置，银行出给银行。总体而言，短端、中长端和长端收益震荡，变动不大。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	1.92		2		2.01		2.06		2.05	
	AA+	1.96		2.03		2.05		2.07		2.18	
	AA	2.05		2.06		2.1		2.18		2.25	
	AA-	2.1		2.28		2.32		2.33		2.4	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	1.92	0	2.01	-1	2.04	-3	2.07	-1	2.1	-5
	AA+	1.93	3	2.07	-4	2.06	-1	2.1	-3	2.12	6
	AA	2.01	4	2.08	-2	2.12	-2	2.13	5	2.21	4

	AA-	2.2	-10	2.3	-2	2.31	1	2.35	-2	2.4	0
--	-----	-----	-----	-----	----	------	---	------	----	-----	---

中期票据

今日中票交投情绪平淡，1-3 年短端中票，23 融和融资 MTN007(碳中和债) (AAA, 1.01Y) 在 2.18%高估值 2bp 位置成交；20 深能源 MTN002 (AAA, 1.03Y) 在 2.08%估值位置成交；24 福州新发 MTN001 (AAA, 1.35Y) 在 2.22%低估值 1bp 位置成交；3 到 5 年期限，23 陕煤化 MTN002 (AAA, 3.47Y) 在 2.48%估值位置成交；23 汇金 MTN006B (AAA, 3.99Y) 成交在 2.35%高估值 2bp 位置成交；24 南京交建 MTN001 (AAA, 4.48Y) 成交在 2.51%，低估值 1bp 位置。5Y 及以上期限，24 中国航材 MTN001 (AAA, 9.82Y) 在 2.75%估值成交；24 苏交通 MTN001 (AAA, 9.35Y) 成交在 2.57%，低估值 1bp 的位置成交。总体而言，今日中票收益震荡，略有下行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.05		2.27		2.39		2.51		None	
	AAA	2.16		2.37		2.56		None		None	
	AA+	2.35		2.49		2.74		None		None	
	AA	2.47		2.63		3.02		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.05	0	2.27	0	2.38	1	2.5	1	None	None
	AAA	2.17	-1	2.38	-1	2.54	2	None	None	None	None
	AA+	2.35	0	2.5	-1	2.72	2	None	None	None	None
	AA	2.46	1	2.63	0	3.01	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， 16 中油 02 AAA 成交在 2.05%，基金卖出，基金买入。24 财金 06 AAA 成交在 2.41%，银行卖出，基金买入。24 首钢 03 AAA 成交在 2.54%。城投方面，20 宜宾国资 05 AAA 成交在 2.15%，基金卖出，理财买入。24 蓉产 02 AAA 成交在 2.56%，理财卖出，券商买入。20 荆经开债 AA 成交在 2.68%。长端方面，24 焦煤 K1 AAA 成交在 2.81%。24 葛洲 K2 AAA 成交在 2.63%。24 国投 06 AAA 成交在 2.63%，基金卖出，保险买入。

银行债

今日银行债成交活跃，整体下行，盘中略有震荡，各期限均换手充分。5Y 大行二级早盘情绪较佳，早盘成交在估值-1 到-2 附近，随后在此区间内震荡直至收盘，基金、理财和券商出给基金、券商和保险。3Y 附近，早盘成交在估值-1，随后在估值-1 至估值-2 之间震荡直至收盘，理财、券商和保险出给基金和券商。短端今日交投活跃，换手较为充分，成交多在估值-1 至估值-3，理财和基金出给基金、理财和券商。商金方面，成交多在估值-1 附近，基金、券商和理财出给银行和基金。

美元债

周三短端卖盘增加。投资级方面，1-2Y 银行、券商、租赁固息与浮息债卖盘增加，但买盘观望情绪浓厚。城投板块，1-2Y 投资级获利了结卖盘增加，但买卖双方对峙在 5.6-5.7%/5.3-5.4%，其中 27 年到期赣州城投（惠誉 BBB-）成交在 5.5%位置。地产板块，国企地产名字如越秀、金茂、中海等近期关注度增加，万科、龙湖上涨 0.25-0.5pt。

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
6D	012483036.IB	24 航天电子 SCP009	AA+	2.08%
6D	012483036.IB	24 航天电子 SCP009	AA+	2.08%
14D	012480732.IB	24 京电子城 SCP001	AA	2.40%
14D	012480732.IB	24 京电子城 SCP001	AA	2.40%
23D	042380649.IB	23 水发集团 CP002	AAA	2.38%
29D	012480696.IB	24 静安置业 SCP002	AA+	2.08%
38D(休 2)	012480812.IB	24 抚州投资 SCP001	AA+	2.35%
42D	042380734.IB	23 连云工投 CP002	AA	2.45%
44D	042380738.IB	23 西汇投资 CP002	AA	2.52%

55D	012481153.IB	24 知识城 SCP001	AAA	2.04%
57D	012481205.IB	24 浙小商 SCP002	AAA	2.02%
67D(休 1)	012481243.IB	24 冀能股份 SCP001	AA+	2.54%
83D	012481486.IB	24 昆明交通 SCP003	AAA	2.90%
85D	012481502.IB	24 粤珠江 SCP002	AAA	2.30%
122D(休 2)	042480106.IB	24 连云城建 CP001	AA+	2.40%
137D(休 1)	012481883.IB	24 荆州城发 SCP001	AA+	2.36%
146D	042480168.IB	24 晋江产投 CP002	AA+	2.38%
155D	042480194.IB	24 可克达拉 CP001	AA+	2.53%
167D	012483319.IB	24 拱墅国投 SCP004	AA+	2.24%
173D	012482257.IB	24 海安经开 SCP003	AA	2.46%
188D	012482388.IB	24 桂铁投 SCP002	AAA	2.19%
219D	072410083.IB	24 东兴证券 CP001	AAA	1.99%
230D	012483089.IB	24 西安高新 SCP003	AAA	2.45%
262D(休 2)	012483366.IB	24 东南国资 SCP007	AAA	2.06%
264D	012483395.IB	24 抚州投资 SCP002	AA+	2.42%
264D	012483395.IB	24 抚州投资 SCP002	AA+	2.42%
281D	042480395.IB	24 平安租赁 CP004	AAA	2.45%
294D	042480489.IB	24 电网 CP021	AAA	2.00%
294D	042480489.IB	24 电网 CP021	AAA	2.00%
294D	042480489.IB	24 电网 CP021	AAA	2.00%
294D	042480489.IB	24 电网 CP021	AAA	2.00%

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
5D	102102252.IB	21 保利发展 MTN003	AAA	2.25%
6D	132100135.IB	21 中广核租 GN002(碳中和 债)	AA+	2.10%
18D(休 1)	102102318.IB	21 粤电发 MTN002	AAA	2.01%
37D+2Y(休 1)	102383270.IB	23 泰达城发 MTN002	AA+	2.50%
41D+2Y	102103222.IB	21 镜湖开发 MTN002	AAA	2.11%
60D(休 1)	102103346.IB	21 中建投资 MTN002	AAA	2.00%
80D+NY(休 2)	102380118.IB	23 华电股 MTN001(能源保供 特别债)	AAA	2.15%
90D(休 7)	102280238.IB	22 国药租赁 MTN001	AAA	2.20%
134D	102000334.IB	20 燕子矶片 MTN001	AA+	2.35%
138D+NY	102380577.IB	23 江宁城建 MTN002	AAA	2.40%
144D(休 1)	102380648.IB	23 科学广州 MTN002	AA+	2.36%
144D(休 1)	102380648.IB	23 科学广州 MTN002	AA+	2.36%
144D(休 1)	102380648.IB	23 科学广州 MTN002	AA+	2.36%
149D+1Y(休 2)	102280646.IB	22 南通城建 MTN001	AAA	2.10%
160D+2Y	102280739.IB	22 津渤海 MTN002	AAA	2.82%
171D+2Y	102280817.IB	22 临空港 MTN001	AA+	2.40%
202D	102001037.IB	20 晋煤 MTN004	AAA	2.30%
212D	102281147.IB	22 中航租赁 MTN004	AAA	2.14%
212D	102281147.IB	22 中航租赁 MTN004	AAA	2.14%
233D	102383395.IB	23 水发集团 MTN002	AAA	2.70%
248D(休 2)	102381596.IB	23 中电投 MTN024	AAA	2.04%

258D	102281565.IB	22 中航租赁 MTN005	AAA	2.14%
262D+2Y	102381732.IB	23 国新租赁 MTN001	AAA	2.15%
270D(休 1)	102281650.IB	22 浙国贸 MTN004	AAA	2.38%
270D(休 1)	102281650.IB	22 浙国贸 MTN004	AAA	2.38%
270D(休 1)	102281650.IB	22 浙国贸 MTN004	AAA	2.38%
291D+NY(休 1)	102281813.IB	22 大唐发电 MTN007	AAA	2.19%
293D+2Y	102281853.IB	22 湖交投 MTN001	AAA	2.20%
303D	102281962.IB	22 白马湖 MTN001	AA/AA+	2.60%
347D+NY(休 1)	102282224.IB	22 中铁建 MTN001	AAA	2.20%
1Y	102002035.IB	20 福州城投 MTN003	AAA	2.15%
1Y	102282414.IB	22 淮安国投 MTN002	AAA	2.31%
1.01Y(休 2)	102382955.IB	23 东楚投资 MTN003	AA+	2.59%
1.01Y(休 2)	102382955.IB	23 东楚投资 MTN003	AA+	2.59%
1.01Y	102382998.IB	23 融和融资 MTN007(碳中和 债)	AAA	2.18%
1.01Y	102382998.IB	23 融和融资 MTN007(碳中和 债)	AAA	2.18%
1.03Y(休 1)	102002108.IB	20 成华国资 MTN001	AA+	2.45%
1.03Y(休 1)	102002108.IB	20 成华国资 MTN001	AA+	2.45%
1.03Y	102002120.IB	20 深能源 MTN002	AAA	2.08%
1.05Y+NY	102383080.IB	23 天安煤业 MTN003(科创票 据)	AAA	2.65%
1.2Y(休 2)	102480067.IB	24 水发集团 MTN001A	AAA	2.86%
1.21Y	102480131.IB	24 云能投 MTN002	AAA	2.60%
1.25Y	102480358.IB	24 云铁投 MTN001	AA+	2.84%
1.32Y	102480516.IB	24 云能投 MTN003	AAA	2.60%
1.33Y(休 2)	102380341.IB	23 如皋交通 MTN001	AA+	2.45%
1.35Y+2Y	102480724.IB	24 福州新发 MTN001	AAA	2.22%
1.35Y+2Y	102480724.IB	24 福州新发 MTN001	AAA	2.22%
1.43Y	102380779.IB	23 厦门市政 MTN001	AAA	2.18%
1.45Y+NY	102380883.IB	23 甬开投 MTN001	AAA	2.42%
1.47Y+2Y	102380967.IB	23 徐州新盛 MTN002	AAA	2.24%
1.47Y	102381009.IB	23 锡产业 MTN005	AAA	2.29%
1.49Y	102100837.IB	21 苏国信 MTN002B	AAA	2.16%
1.54Y	102383054.IB	23 津城建 MTN012	AAA	2.65%
1.56Y(休 1)	102482035.IB	24 碧水源 MTN002(绿色)	AA+	2.70%
1.73Y(休 2)	102381651.IB	23 鄂文旅 MTN002	AAA	2.53%
1.78Y	102382024.IB	23 苏交通 MTN003	AAA	2.19%
1.81Y(休 1)	102382183.IB	23 南通城建 MTN002	AAA	2.27%
1.82Y+NY	132380061.IB	23 三峡 GN002	AAA	2.22%
1.84Y+6Y	102382305.IB	23 衡阳滨江 MTN001	AA	2.85%
1.91Y(休 1)	102484312.IB	24 中广核 MTN005(科创票据)	AAA	2.20%
1.96Y+2Y	102382726.IB	23 椒江国资 MTN001	AA+	2.43%
2.06Y	102383095.IB	23 晋能电力 MTN018	AAA	2.52%
2.06Y	102383095.IB	23 晋能电力 MTN018	AAA	2.52%
2.14Y+2Y	102383368.IB	23 乌城轨 MTN003	AA+	2.54%
2.14Y	102383400.IB	23 金坛投资 MTN003	AA	2.56%
2.16Y+2Y	102300579.IB	23 华靖资产 MTN003	AA+	2.61%

2.18Y	102480022.IB	24 南京浦口 MTN001	AA+	2.55%
2.22Y(休 1)	102480169.IB	24 新海连 MTN001	AA+	2.60%
2.25Y	102480324.IB	24 盐城国投 MTN001	AA+	2.84%
2.25Y	102480324.IB	24 盐城国投 MTN001	AA+	2.84%
2.25Y+2Y	102480373.IB	24 湖交投 MTN001	AAA	2.39%
2.27Y(休 6)	102480455.IB	24 乌高新 MTN001	AA+	2.60%
2.27Y(休 6)	102480468.IB	24 南川城投 MTN001	AA	3.41%
2.45Y(休 1)	102280742.IB	22 川发展 MTN001	AAA	2.32%
2.48Y(休 1)	102481781.IB	24 金家岭 MTN003	AA+	2.55%
2.55Y	102481952.IB	24 光大环境 MTN002A	AAA	2.40%
2.77Y(休 2)	102483335.IB	24 中国水务 MTN001BC(绿色)	AA+	3.27%
2.77Y(休 2)	102483335.IB	24 中国水务 MTN001BC(绿色)	AA+	3.27%
2.85Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	2.26%
2.85Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	2.26%
2.85Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	2.26%
3.47Y	102380937.IB	23 陕煤化 MTN002	AAA	2.48%
3.47Y	102380937.IB	23 陕煤化 MTN002	AAA	2.48%
3.99Y	102382915.IB	23 汇金 MTN006B	AAA	2.35%
3.99Y	102382915.IB	23 汇金 MTN006B	AAA	2.35%
4.38Y(休 1)	102480940.IB	24 红谷滩 MTN001	AA+	2.97%
4.41Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	2.37%
4.41Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	2.37%
4.41Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	2.37%
4.41Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	2.37%
4.41Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	2.37%
4.48Y	102481715.IB	24 南京交建 MTN001	AAA	2.51%
4.48Y	102481715.IB	24 南京交建 MTN001	AAA	2.51%
4.49Y	102481821.IB	24 德阳发展 MTN001	AA+	2.92%
4.55Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.37%
4.55Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.37%
4.55Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.37%
4.55Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.38%
4.55Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	2.38%
4.62Y	102482282.IB	24 洪市政 MTN004	AAA	2.53%
4.74Y	102483215.IB	24 南电 MTN007	AAA	2.37%
4.9Y	102484237.IB	24 新兴际华 MTN005	AAA	2.60%
4.9Y	102484237.IB	24 新兴际华 MTN005	AAA	2.60%
9.82Y(休 2)	102483759.IB	24 中国航材 MTN001	AAA	2.75%

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(休 1)	188959.SH	21 港投 02	AAA	2.25%
4D(休 1)	188959.SH	21 港投 02	AAA	2.25%
68D+NY	196126.SH	22 临开 Y1	AA+	2.15%
72D+2Y(休 1)	163112.SH	20 金隅 02	AAA	2.10%
82D	162994.SH	20 安阳 02	AA	2.65%

98D	143474.SH	18 陕投 02	AAA	2.11%
117D	163153.SH	20 浦建 01	AA+	2.21%
117D	163153.SH	20 浦建 01	AA+	2.21%
131D	2080041.IB	20 国新控股债转股债 01	AAA	2.07%
131D	2080041.IB	20 国新控股债转股债 01	AAA	2.07%
134D	250183.SH	23 淮清 03	AA+	2.58%
136D+1Y(休 1)	115054.SH	23 渝物 02	AA+	2.65%
136D+1Y(休 1)	115054.SH	23 渝物 02	AA+	2.65%
138D+2Y	194152.SH	22 威海 01	AA+	2.24%
145D+NY	115089.SH	GY 天成 01	AAA	2.33%
146D	253698.SH	24 金水 D1	AA+	3.22%
151D(休 1)	152438.SH	20 宜国 01	AAA	2.13%
164D+2Y	115210.SH	23 安租 06	AAA	2.57%
166D	149092.SZ	20 穗控 02	AAA	2.07%
212D+2Y(休 1)	194607.SH	22 钱塘 01	AA+	2.20%
215D+5Y(休 1)	2023011.IB	20 中英人寿 01	AAA/AA+	2.25%
215D+5Y(休 1)	2023011.IB	20 中英人寿 01	AAA/AA+	2.25%
227D+NY(休 2)	115501.SH	23 中公 Y1	AAA	2.30%
227D+NY(休 2)	115501.SH	23 中公 Y1	AAA	2.30%
232D+3Y	251476.SH	23 绵控 03	AA+	2.50%
243D	185939.SH	22 华电 01	AAA	1.95%
243D	185939.SH	22 华电 01	AAA	1.95%
248D+1Y(休 1)	251626.SH	23 上饶 02	AA+	2.70%
249D+2Y	185968.SH	22 首城 02	AAA	2.90%
249D(休 1)	185969.SH	22 粤港 02	AAA	2.08%
251D	185986.SH	22 建银 03	AAA	2.08%
257D	185962.SH	22 义创 G1	AAA	2.18%
265D+2Y	137536.SH	22 中化 T1	AAA	2.14%
265D+2Y	137536.SH	22 中化 T1	AAA	2.14%
297D(休 2)	137686.SH	22 宁沪 G2	AAA	2.06%
302D+5Y	2080227.IB	20 尧矿债 02	AAA	2.14%
303D+2Y(休 1)	148047.SZ	22 润资 02	AAA	2.17%
303D	148046.SZ	22 润资 01	AAA	2.17%
306D	148055.SZ	22 深新 01	AAA	2.06%
306D	148055.SZ	22 深新 01	AAA	2.06%
306D	148055.SZ	22 深新 01	AAA	2.05%
307D	255739.SH	24 滨海 D4	AAA	2.50%
320D	175138.SH	20 中铁 01	AAA	2.40%
324D	137787.SH	22 方正 G1	AAA	2.17%
326D(休 1)	137818.SH	G22 桂冠 3	AAA	2.16%
327D	252541.SH	23 株高 05	AA+	2.85%
362D+3Y	175302.SH	20 青城 04	AAA	2.21%
1Y	145059.SH	17 青城 02	AAA	2.23%
1.14Y+NY(休 1)	138759.SH	铁建 YK01	AAA	2.20%
1.21Y	114564.SH	23 松阳 01	AA/AAA	2.51%
1.22Y	136165.SH	16 中油 02	AAA	2.05%
1.27Y+NY(休 2)	240575.SH	24 恒信 Y1	AAA	2.70%

1.28Y+2Y	114899.SH	23 锡山 01	AA+	2.30%
1.33Y+3Y	133772.SZ	24 哈密 01	AA	2.74%
1.33Y+3Y	133772.SZ	24 哈密 01	AA	2.74%
1.36Y+5Y	175802.SH	21 东航 01	AAA	2.19%
1.4Y	250414.SH	23 台山 01	AA	2.55%
1.4Y	178061.SH	21 市政 02	AA+	2.50%
1.4Y	178061.SH	21 市政 02	AA+	2.50%
1.53Y(休 1)	127352.SH	16 恒投 01	AAA	2.20%
1.54Y(休 2)	152204.SH	PR 长湖 02	AA	2.85%
1.57Y	149486.SZ	21 惠交 01	AAA	2.25%
1.57Y	149486.SZ	21 惠交 01	AAA	2.25%
1.57Y	149486.SZ	21 惠交 01	AAA	2.25%
1.61Y	251196.SH	23 浦江 01	AA	2.54%
1.7Y(休 2)	251650.SH	23 临资 02	AA/AA+	2.90%
1.7Y(休 1)	196549.SH	21 余投 02	AA+	2.44%
1.8Y	115817.SH	23 银河 G3	AAA	2.17%
1.8Y	115817.SH	23 银河 G3	AAA	2.17%
1.8Y	115817.SH	23 银河 G3	AAA	2.17%
1.88Y	137527.SH	22 安租 17	AAA	2.95%
1.89Y(休 1)	115961.SH	23 扬子 G2	AAA	2.29%
2.02Y	240150.SH	23 浙金 03	AAA	2.27%
2.13Y	148549.SZ	23 国证 12	AAA	2.205%
2.16Y+2Y	148560.SZ	23 长轨 G4	AAA	2.23%
2.21Y(休 2)	240502.SH	24 平证 02	AAA	2.29%
2.22Y(休 1)	240497.SH	24 交投 01	AAA	2.35%
2.22Y(休 1)	240497.SH	24 交投 01	AAA	2.35%
2.33Y+2Y	240594.SH	24 鄂旅 01	AAA	2.63%
2.33Y(休 2)	240595.SH	24 华安 G1	AAA	2.29%
2.38Y	254033.SH	24 九龙 01	AA	3.00%
2.58Y(休 2)	241060.SH	24 黔高 02	AAA	2.44%
2.59Y	241036.SH	G24 宁铁 1	AAA	2.25%
2.59Y	241036.SH	G24 宁铁 1	AAA	2.28%
2.62Y	241066.SH	24 大兴 01	AAA	2.34%
2.74Y+NY	148005.SZ	22 申证 Y1	AAA	2.40%
2.78Y	241330.SH	24 沪房 01	AA+	2.46%
2.78Y	241330.SH	24 沪房 01	AA+	2.46%
2.82Y	2080222.IB	20 当阳债	AA/AAA	2.73%
2.95Y+NY(休 1)	241720.SH	24 电能 Y1	AAA	2.56%
2.96Y(休 2)	241736.SH	24 兴业 07	AAA	2.28%
2.98Y+2Y	241783.SH	24 财金 06	AAA	2.41%
2.98Y+2Y	241783.SH	24 财金 06	AAA	2.41%
4.32Y	240587.SH	24 海通 02	AAA	2.35%
4.32Y	240587.SH	24 海通 02	AAA	2.35%
4.61Y+NY	148768.SZ	24 蜀道 Y3	AAA	2.58%
7.71Y	149991.SZ	22 广发 03	AAA	2.48%
14.73Y	241338.SH	24 国投 06	AAA	2.63%
30D	032191331.IB	21 圆山发展 PPN001	AA	2.42%

118D	032480949.IB	24 六安城投 PPN004	AA+	2.44%
131D+1Y	032380201.IB	23 济源投资 PPN002	AA+	3.10%
131D+1Y	032380201.IB	23 济源投资 PPN002	AA+	3.10%
175D	032000241.IB	20 常城建 PPN001	AAA	2.13%
1.44Y	032380333.IB	23 宿州城投 PPN002	AA+	2.50%
1.49Y(休 1)	032380409.IB	23 吉安城建 PPN001	AA+	2.50%
1.63Y+2Y	032380559.IB	23 连云城建 PPN002	AA+	2.51%
1.72Y	032300441.IB	23 金华城投 PPN001	AA+	2.38%
1.81Y(休 2)	032480918.IB	24 济南产业 PPN002	AA+	3.20%
4.91Y	032481013.IB	24 舟山交投 PPN003	AA+	2.70%
4.91Y	032481013.IB	24 舟山交投 PPN003	AA+	2.70%
4.91Y	032481013.IB	24 舟山交投 PPN003	AA+	2.70%
11D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.15%
11D(休 1)	2128035.IB	21 华夏银行 02	AAA	2.15%
13D+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	1.87%
13D+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	1.87%
13D+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	1.87%
13D+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	1.86%
42D+NY	1928036.IB	19 中信银行永续债	AAA	2.03%
57D+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	2.08%
61D+5Y(休 1)	1920091.IB	19 南京银行二级	AAA	2.03%
61D+5Y(休 1)	1920091.IB	19 南京银行二级	AAA	2.03%
87D(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	2.00%
87D(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	2.00%
87D(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	2.00%
139D+NY	2028006.IB	20 邮储银行永续债	AAA	2.095%
180D	2228028.IB	22 中信银行 01	AAA	1.95%
277D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.11%
277D+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.11%
279D	2228046.IB	22 中信银行 02	AAA	1.96%
324D	2220064.IB	22 郑州银行绿色债 01	AAA	1.97%
326D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.10%
326D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.10%
326D+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.10%
329D+5Y	2028041.IB	20 工商银行二级 01	AAA	2.10%
334D	2220067.IB	22 杭州银行债 01	AAA	2.00%
350D+NY	2028042.IB	20 兴业银行永续债	AAA	2.16%
1.03Y	2228057.IB	22 浦发银行 04	AAA	1.95%
1.03Y	2228057.IB	22 浦发银行 04	AAA	1.95%
1.07Y+NY	2028052.IB	20 恒丰银行永续债	AAA	2.45%
1.07Y+NY	2020078.IB	20 成都银行永续债	AAA	2.28%
1.12Y+5Y(休 2)	2021038.IB	20 杭联农商二级 01	AAA/AA+	2.25%
1.23Y+5Y	2128002.IB	21 工商银行二级 01	AAA	2.13%
1.53Y+NY	2121021.IB	21 江南农商永续债	AAA/AA+	2.35%
1.58Y(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	2.07%
1.58Y(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	2.07%
1.58Y(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	2.07%

1.6Y+5Y(休 2)	2120047.IB	21 宁波银行二级 01	AAA	2.24%
1.61Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.225%
1.61Y+NY	2128021.IB	21 工商银行永续债 01	AAA	2.225%
1.61Y+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	2.23%
1.7Y+5Y(休 2)	2120062.IB	21 宁波银行二级 02	AAA	2.25%
1.75Y(休 2)	212380010.IB	23 华夏银行债 03	AAA	2.08%
1.82Y	2320041.IB	23 南京银行 01	AAA	2.12%
1.97Y+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	2.34%
1.97Y+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	2.34%
1.97Y+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	2.34%
1.97Y+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	2.34%
1.97Y+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	2.35%
1.99Y+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	2.27%
1.99Y+5Y(休 1)	2120092.IB	21 徽商银行二级 01	AAA	2.33%
2.05Y+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AAA	2.30%
2.12Y+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	2.36%
2.12Y+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	2.36%
2.21Y+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	2.29%
2.22Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	2.33%
2.22Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	2.255%
2.24Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.26%
2.24Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.26%
2.24Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	2.26%
2.35Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.27%
2.35Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.27%
2.35Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.27%
2.35Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.27%
2.35Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	2.27%
2.55Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.28%
2.55Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA	2.28%
2.68Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.19%
2.68Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.19%
2.69Y+5Y	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	AAA	2.355%
2.69Y+5Y	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	AAA	2.355%
2.69Y+5Y	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	AAA	2.355%
2.69Y+5Y	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	AAA	2.36%
2.71Y	2420031.IB	24 苏州银行 01	AAA	2.22%
2.76Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	2.36%
2.76Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	2.36%
2.76Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	2.36%
2.81Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	2.165%
2.83Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	2.34%
2.83Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	2.35%
2.83Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	2.35%
2.83Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	2.35%
2.83Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	2.35%
2.84Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	2.375%

2.9Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.295%
2.9Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	2.295%
2.91Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	AAA	2.16%
2.98Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	2.42%
2.98Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	2.42%
2.98Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	2.42%
2.98Y+NY(休 1)	092280105.IB	22 南京银行永续债 01	AAA	2.42%
3.16Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA/AA+	2.51%
3.4Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	2.33%
3.4Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	2.33%
3.45Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA	2.33%
3.58Y+5Y(休 1)	232380021.IB	23 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.445%
3.72Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	2.43%
3.83Y+NY	242380017.IB	23 农行永续债 01	AAA	2.43%
3.83Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	2.37%
3.89Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	2.38%
3.89Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	2.38%
3.99Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	2.39%
4Y+5Y	232380073.IB	23 农行二级资本债 03A	AAA	2.39%
4.14Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	2.45%
4.14Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	2.45%
4.14Y+5Y	232380089.IB	23 中信银行二级资本债 01A	AAA	2.45%
4.27Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.41%
4.27Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.41%
4.44Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.41%
4.44Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.41%
4.44Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.41%
4.44Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.41%
4.47Y+5Y	232480010.IB	24 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.53%
4.47Y+5Y	232480010.IB	24 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.53%
4.48Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.52%
4.48Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.41%
4.48Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.41%
4.48Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.41%
4.48Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.415%
4.48Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.415%
4.49Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.515%
4.49Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.515%
4.49Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.515%
4.5Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.415%
4.5Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.41%
4.5Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.42%
4.5Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.42%
4.56Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.49%
4.56Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.49%
4.56Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.49%
4.59Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.58%

4.59Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.575%
4.6Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.48%
4.64Y+NY	242480005.IB	24 杭州银行永续债 01	AAA	2.56%
4.64Y+NY	242480005.IB	24 杭州银行永续债 01	AAA	2.56%
4.64Y+NY	242480005.IB	24 杭州银行永续债 01	AAA	2.56%
4.64Y+NY	242480005.IB	24 杭州银行永续债 01	AAA	2.56%
4.64Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.555%
4.64Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.555%
4.69Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.415%
4.69Y+5Y	232480032.IB	24 兴业银行二级资本债 02	AAA	2.49%
4.7Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.55%
4.7Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.545%
4.7Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.55%
4.7Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.55%
4.7Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.55%
4.7Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.485%
4.7Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.485%
4.74Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.415%
4.75Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.48%
4.75Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.485%
4.75Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.49%
4.75Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.49%
4.76Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.53%
4.76Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.53%
4.79Y+5Y	1928020.IB	19 交通银行二级 02	AAA	2.42%
4.79Y+5Y	1928020.IB	19 交通银行二级 02	AAA	2.42%
4.83Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.49%
4.83Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.49%
4.83Y+NY	242400020.IB	24 交行永续债 01BC	AAA	2.49%
4.99Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	2.42%
9.76Y+5Y	232480040.IB	24 广发银行二级资本债 01B	AAA	2.70%

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

Thanks & Best Regards

