

收盘日评
银行间债券市场

常规报告系列



【2023-02-03】

国债

国债方面 268D 220023 成交 2.04-,350D 230001 成交 2.115-2.13, 1.9Y 220028 成交 2.385-2.39, 2.32Y 220011 成交 2.44, 2.57Y 220018 成交 2.49-2.50, 4.48Y 220016 成交 2.69-2.695, 6.37Y 220012 成交 2.835, 7.3Y 200006 成交 2.875, 9.54Y 220017 成交 2.9125-2.92, 9.79Y 220025 成交 2.8875-2.905, 29.21Y 220008 成交 3.2775-3.29

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	2.0400	2.4300	2.6600	2.8100	2.8950	3.2825
今日国债(%)	2.0100	2.4100	2.6600	2.8150	2.8925	3.2850
变动(%)	-0.0300	-0.0200	0.0000	0.0050	-0.0025	0.0025

金融债

金融债方面 179D 220211 成交 2.14-2.17, 270D 220216 成交 2.26-2.28,, 2.95Y 230202 成交 2.685-2.695, 3.09Y 210203 成交 2.72-2.74, 4.07Y 220203 成交 2.835-2.845, 4.38Y 220208 成交 2.83-2.85, 4.95Y 230203 成交 2.8475-2.865, 9.46Y 220215 成交 3.065-3.07, 9.73Y 220220 成交 3.045-3.06

	1	3	5	7	10
昨日非国金融债(%)	2.3050	2.6650	2.8800	3.0100	3.0900
今日非国金融债(%)	2.3000	2.6650	2.8600	3.0100	3.0900
变动(%)	-0.0050	0.0000	-0.0200	0.0000	0.0000
昨日国开债(%)	2.2700	2.6200	2.8400	2.9975	3.0725
今日国开债(%)	2.2775	2.6200	2.8425	3.0000	3.0750
变动(%)	0.0075	0.0000	0.0025	0.0025	0.0025

短期融资券

今日短融交投情绪较为活跃，成交主要集中在各期限 AAA AA+短融产品。短端方面，21D 042280089 22 国电 CP001 AAA 成交在 2.20%位置，银行出给基金，55D 012380342 23 伊利实业 SCP005 AAA 成交在 2.40%位置，银行出给基金；中长端方面，124D 012284265 22 粤电发 SCP003 AAA 成交在 2.51%

位置，银行出给基金；164D 012380301 23 南电 SCP001 AAA 成交在 2.47%位置，银行出给基金；长端方面，210D 072210145 22 招商证券 CP008 AAA 成交在 2.55%位置，双边均为基金，341D 042380016 23 海通恒信 CP001 AAA 成交在 3.32%位置； 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	2.35		2.43		2.66		2.92		3.0	
	AA+	2.7		2.8		3.12		3.2		3.3	
	AA	3.28		3.48		3.91		4.1		4.25	
	AA-	3.7		4.02		4.51		4.67		4.9	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	2.37	-2	2.48	-5	2.64	2	2.94	-2	2.98	2
	AA+	2.7	0	2.82	-2	3.1	2	3.22	-2	3.4	-10
	AA	3.3	-2	3.58	-10	3.95	-4	4.18	-8	4.3	-5
	AA-	3.72	-2	4.02	0	4.51	0	4.67	0	4.9	0

中期票据

今日中票交投情绪较为活跃。1-3 年短端中票，买盘情绪延续，1.0Y-2.0Y 较为集中，21 光明 MTN001 (AAA, 1.22Y) 成交在 2.77%，较昨日下午行 2bp；19 国新控股 MTN003 (AAA, 1.47Y) 成交在 2.85%，较昨日下午行 2bp；21 苏国信 MTN014 (AAA, 1.77Y) 在 2.93%成交 2 笔；20 中石油 MTN003 (AAA, 2.13Y) 在 2.96%成交；22 南电 MTN004 (AAA, 2.72Y) 在 3.07%成交 5 笔，较昨日下午行 1bp。3 到 5 年期限，成交一般，21 蜀道投资 MTN005 (AAA, 3.79Y) 在 3.65%成交 3 笔；22 国新控股 MTN003(能源保供特别债) (AAA, 4.65Y) 在 3.43%成交 6 笔，较昨日下午行 3bp。5Y 及以上期限，成交寡淡。总体而言，今日中票收益率日内震荡，略有下行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2.73		3.02		3.26		3.55		None	
	AAA	2.89		3.25		3.48		3.76		None	
	AA+	3.25		3.93		4.15		None		None	
	AA	3.69		4.15		4.56		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	2.74	-1	3.03	-1	3.28	-2	3.56	-1	None	None
	AAA	2.9	-1	3.27	-2	3.51	-3	3.78	-2	None	None
	AA+	3.27	-2	3.92	1	4.18	-3	None	None	None	None
	AA	3.72	-3	4.16	-1	4.6	-4	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,19 蛇口 01 AAA 成交在 2.80%，银行卖出，基金买入。20 徐工 01 AAA 成交在 2.67%，银行卖出，基金买入。城投方面，21 赣铁 01 AAA 成交在 3.65%，券商卖出，银行买入。22 台州 01 AAA 成交在 3.50%，券商卖出，基金买入。长端方面，21 深能 02 AAA 成交在 3.61%。

投资版块较昨日波动不大，由于近一周市场没有大规模新发公募债，投资者继续购入旧券，城投延续坚挺且 23-25 年的城投债买盘需求强烈，24 年小量卖盘出现即售空。自甘肃、广西、重庆和银川等中西部地区名字交投活跃。地产版块， 中骏 CHINSC/雅居乐 AGILE/金茂 CHJMAO 等交投活跃其中中骏 23 在 87 附近有成交。

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
18D	042280079.IB	22 万华化学 CP005	AAA	2.27%
21D	042280089.IB	22 国电 CP001	AAA	2.20%
21D	012282964.IB	22 徐工集团 SCP016	AAA	2.32%
25D	012282185.IB	22 越秀租赁 SCP004	AAA	2.56%
31D	042280238.IB	22 电网 CP004	AAA	2.20%
31D	012282050.IB	22 鲲鹏资本 SCP002	AAA	2.40%
32D	012380069.IB	23 中建八局 SCP002	AAA	2.35%
32D	012283864.IB	22 武钢集 SCP006	AAA	2.40%
33D	072210122.IB	22 东北证券 CP006	AAA	2.40%
47D	012380332.IB	23 海南农垦 SCP001	AAA	2.80%
47D	012380332.IB	23 海南农垦 SCP001	AAA	2.80%
55D	012380342.IB	23 伊利实业 SCP005	AAA	2.40%
55D	012380342.IB	23 伊利实业 SCP005	AAA	2.40%
61D(休 1)	012284192.IB	22 新水国资 SCP002	AA	3.50%
67D	012282477.IB	22 越秀集团 SCP010	AAA	2.44%
67D	012282477.IB	22 越秀集团 SCP010	AAA	2.44%
68D	012380181.IB	23 经开国发 SCP002	AA+	2.90%
68D	012283338.IB	22 通商租赁 SCP007	AAA	2.56%
70D	0132380002.IB	23 华能水电 GN002	AAA	2.43%
84D	072210067.IB	22 广发证券 CP006	AAA	2.38%
91D	012282747.IB	22 闽能源 SCP001	AAA	2.47%
91D	012282747.IB	22 闽能源 SCP001	AAA	2.47%
124D	012284265.IB	22 粤电发 SCP003	AAA	2.51%
133D	012380326.IB	23 太仓水务 SCP001	AA	3.48%
142D(休 1)	012283359.IB	22 甬开投 SCP003	AAA	2.55%
159D	012380232.IB	23 赣出版 SCP001	AAA	2.60%
159D	012380232.IB	23 赣出版 SCP001	AAA	2.60%
159D	012380232.IB	23 赣出版 SCP001	AAA	2.60%

159D	012380232.IB	23 赣出版 SCP001	AAA	2.60%
162D(休 2)	012380251.IB	23 渝医药 SCP001	AA+	3.70%
162D(休 2)	012380251.IB	23 渝医药 SCP001	AA+	3.70%
162D(休 2)	012380251.IB	23 渝医药 SCP001	AA+	3.70%
164D	012380301.IB	23 南电 SCP001	AAA	2.47%
168D	012380215.IB	23 环球租赁 SCP002	AAA	3.07%
168D	012380215.IB	23 环球租赁 SCP002	AAA	3.07%
168D	012380215.IB	23 环球租赁 SCP002	AAA	3.07%
178D	012283837.IB	22 蓉城轨交 SCP001	AAA	2.66%
202D	042280382.IB	22 黄石众邦 CP002	AA	4.65%
210D	072210145.IB	22 招商证券 CP008	AAA	2.50%
260D(休 2)	042280464.IB	22 苏沙钢 CP003	AAA	4.55%
260D(休 2)	042280464.IB	22 苏沙钢 CP003	AAA	4.55%
260D(休 2)	042280464.IB	22 苏沙钢 CP003	AAA	4.55%
266D	042280481.IB	22 津城建 CP031	AAA	7.60%



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
51D	101800290.IB	18 越秀集团 MTN001	AAA	2.39%
69D	101800378.IB	18 津城建 MTN009	AAA	5.44%
77D	102000756.IB	20 中国一汽 MTN002	AAA	2.47%
78D	102000760.IB	20 昊华(疫情防控债)MTN001	AA+/AAA	2.80%
184D	101800845.IB	18 上饶投资 MTN001	AAA/AA+	3.54%
191D	101800871.IB	18 金隅 MTN003	AAA	2.60%
191D	101800871.IB	18 金隅 MTN003	AAA	2.60%
192D+NY	102001539.IB	20 中煤集团 MTN001	AAA	2.90%
340D	101900015.IB	19 中石油 MTN001	AAA	2.68%
356D	101900132.IB	19 深圳创投 MTN002	AAA	2.80%
1.1Y	102100411.IB	21 兖矿 MTN002	AAA	2.92%
1.12Y	102100462.IB	21 武汉车都 MTN001A	AA+	3.27%
1.15Y	101900329.IB	19 湘高速 MTN002	AAA	2.91%
1.15Y	101900329.IB	19 湘高速 MTN002	AAA	2.91%
1.18Y+2Y	102100637.IB	21 新长宁 MTN002	AAA	2.98%
1.33Y	102101016.IB	21 黄石城发 MTN001	AA+	4.80%

1.33Y	102101016.IB	21 黄石城发 MTN001	AA+	4.80%
1.46Y	102101330.IB	21 中航租赁 MTN005	AAA	3.42%
1.48Y	102101403.IB	21 上饶城投 MTN002	AA+	5.05%
1.52Y+NY	102101521.IB	21 川能投 MTN002B	AAA	3.81%
1.58Y	102101787.IB	21 武钢集 MTN001	AAA	3%
1.58Y	102101787.IB	21 武钢集 MTN001	AAA	3%
1.58Y	102101787.IB	21 武钢集 MTN001	AAA	3%
1.75Y	102102233.IB	21 苏州高新 MTN008	AAA	3.22%
1.75Y	102102233.IB	21 苏州高新 MTN008	AAA	3.22%
1.75Y	102102233.IB	21 苏州高新 MTN008	AAA	3.22%
1.85Y	102103224.IB	21 华侨城 MTN006A	AAA	3.44%
1.85Y	102103224.IB	21 华侨城 MTN006A	AAA	3.45%
1.88Y+NY	102282742.IB	22 中电投 MTN042	AAA	3.43%
1.93Y	102280038.IB	22 乌高新 MTN001	AA+	4.51%
1.93Y	102280038.IB	22 乌高新 MTN001	AA+	4.51%
2.06Y	102280358.IB	22 苏州高新 MTN001	AAA	3.35%
2.13Y	102000470.IB	20 中石油 MTN003	AAA	2.96%
2.2Y	102280818.IB	22 沪港务 MTN001	AAA	3.04%
2.23Y+2Y	102280998.IB	22 杭州城发 MTN001A	AA+	3.41%
2.37Y	102281311.IB	22 义乌国资 MTN002	AA+	3.82%
2.42Y	102281493.IB	22 苏交通 MTN003	AAA	3.07%
2.44Y+NY	102281555.IB	22 华阳新材 MTN013	AAA	6.10%
2.54Y	102281841.IB	22 中电投 MTN025	AAA	3.09%
2.54Y	102281841.IB	22 中电投 MTN025	AAA	3.09%
2.56Y+NY	102001627.IB	20 济南轨交 MTN001	AAA	4.31%
2.63Y	102282126.IB	22 国开投 MTN001A	AAA	3.14%
2.64Y	102282144.IB	22 闽能源 MTN004	AAA	3.20%
2.64Y	102282144.IB	22 闽能源 MTN004	AAA	3.20%
2.69Y	102282247.IB	22 晋焦煤 MTN002	AAA	3.55%
2.72Y	102282336.IB	22 南电 MTN004	AAA	3.07%
2.75Y+NY	102282442.IB	22 大唐集 MTN009	AAA	3.80%
2.75Y+NY	102282442.IB	22 大唐集 MTN009	AAA	3.80%
2.8Y	102282560.IB	22 晋能电力 MTN005	AAA	4.40%



剩余天数	债券代码	债券代码（发行机构）	评级	收益率
18D	196446.SH	22 台商 D1	AA	3.61%
34D	136267.SH	16 广越 03	AAA	2.32%
38D+2Y	166286.SH	20 秀宏 01	AA/AA+	3.60%
45D+365D	178025.SH	21 瀚控 01	AA+	3.98%
49D	166369.SH	20 桐城 01	AA+	2.79%
70D+2Y	175939.SH	21 临债 01	AAA	2.55%
77D	2028011.IB	20 农业银行小微债 01	AAA	2.39%
88D(休 2)	150349.SH	18 绍兴 04	AA	4.20%
140D(休 3)	149155.SZ	20 安纾 01	AAA	2.72%
148D(休 2)	136512.SH	16 广安 02	AA+	3.00%
163D(休 1)	143722.SH	18 建材 08	AAA	2.58%
163D(休 1)	143722.SH	18 建材 08	AAA	2.58%
178D+2Y	163651.SH	20 海国 03	AAA	3.21%
185D+2Y	167362.SH	20 吴兴 01	AA+	4.06%
192D+2.99Y	149591.SZ	21 广开 01	AAA	2.95%
192D+2.99Y	149591.SZ	21 广开 01	AAA	2.95%
203D+2Y	114804.SZ	20 铁纾 01	AAA	3.37%
203D	149211.SZ	20 徐工 01	AAA	2.67%
203D	149211.SZ	20 徐工 01	AAA	2.67%
227D+5Y	1828009.IB	18 浦发银行二级 02	AAA	2.75%
227D+2Y	175148.SH	20 科创 01	AAA	2.74%
234D+5Y	1828010.IB	18 建设银行二级 01	AAA	2.73%
266D+NY	175186.SH	20 扬子 Y3	AAA	3.24%
269D+5Y(休 1)	1828013.IB	18 建设银行二级 02	AAA	2.76%
283D+1.99Y	175353.SH	20 昌投 G1	AA+	4.11%
318D+NY	155983.SH	18 铁 Y10	AAA	2.90%
318D+1.99Y	114455.SH	22 淄博 07	AAA	4.10%
364D	175707.SH	21 鲁高 01	AAA	2.86%
1.19Y+5Y	1928009.IB	19 农业银行二级 04	AAA	2.86%
1.23Y+5Y	1928011.IB	19 工商银行二级 03	AAA	2.88%
1.33Y+NY	1928013.IB	19 民生银行永续债	AAA	5.91%
1.33Y+NY	1928013.IB	19 民生银行永续债	AAA	5.90%
1.34Y	151662.SH	19 中企 01	AA+/AAA	3.95%

1.39Y	112921.SZ	19 蛇口 01	AAA	2.80%
1.54Y	162007.SH	19 淮建 01	AA+	6.20%
1.55Y	188612.SH	21 安信 C2	AAA	3.38%
1.56Y	2128027.IB	21 招商银行小微债 03	AAA	2.73%
1.56Y	2128027.IB	21 招商银行小微债 03	AAA	2.73%
1.59Y+NY	1928023.IB	19 农业银行永续债 02	AAA	3.19%
1.64Y+5Y	1928028.IB	19 中国银行二级 01	AAA	3.00%
1.64Y+5Y	1928028.IB	19 中国银行二级 01	AAA	3.00%
1.73Y(休 2)	197399.SH	21 并投 02	AA+	4.09%
1.77Y+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	3.25%
1.77Y+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	3.26%
1.77Y+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	3.26%
1.77Y+5Y	1920066.IB	19 上海银行二级	AAA	3.26%
1.78Y+2Y(休 1)	188964.SH	21SIIC02	AAA	3.31%
1.78Y+2Y(休 1)	188964.SH	21SIIC02	AAA	3.31%
1.78Y+2Y(休 1)	188964.SH	21SIIC02	AAA	3.31%
1.8Y+5Y	1928033.IB	19 中国银行二级 03	AAA	3.05%
1.81Y+NY(休 1)	185056.SH	21 铁工 Y8	AAA	3.48%
1.85Y	162693.SH	19 柯建 02	AA/AA+	4.91%
1.86Y+NY	148143.SZ	22 华润 Y3	AAA	3.45%
1.89Y+NY	1928038.IB	19 平安银行永续债 01	AAA	3.75%
1.94Y	138794.SH	23 国信 01	AAA	3.62%
1.94Y	138794.SH	23 国信 01	AAA	3.62%
1.97Y	196225.SH	22 晋电 01	AAA	4.60%
2.04Y	2220011.IB	22 北京银行小微债 01	AAA	2.84%
2.07Y(休 2)	2228016.IB	22 华夏银行 01	AAA	2.78%
2.13Y	133215.SZ	22 深航 02	AA+	4.70%
2.21Y+2Y	149883.SZ	22 湘路 04	AAA	3.44%
2.25Y	2221018.IB	22 广州农商绿色债	AAA	2.91%
2.33Y	127820.SH	PR 鄂交投	AAA	3.20%
2.37Y+2Y	185897.SH	22 台州 01	AAA	3.50%
2.4Y+5Y(休 2)	2028022.IB	20 民生银行二级	AAA	5.50%
2.5Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	3.38%
2.57Y	137735.SH	22 中财 G5	AAA	3.29%

2.6Y	137799.SH	22 海通 05	AAA	3.09%
2.63Y+NY	2028037.IB	20 光大银行永续债	AAA	3.83%
2.72Y+2Y	133341.SZ	22 赣江 01	AA+/AAA	5.14%
2.74Y+2Y	133343.SZ	22 南翼 03	AA+	5.09%
2.84Y	2220080.IB	22 厦门国际银行	AAA	3.12%
2.86Y(休 2)	2228061.IB	22 交通银行小微债 02	AAA	2.83%
2.86Y(休 2)	2228061.IB	22 交通银行小微债 02	AAA	2.83%
3.02Y+5Y(休 1)	152753.SH	21 赣铁 01	AAA	3.65%
3.15Y+5Y(休 2)	2120018.IB	21 东莞银行二级 01	AAA/AA+	4.30%
3.15Y+5Y(休 2)	2120018.IB	21 东莞银行二级 01	AAA/AA+	4.30%
3.52Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	3.58%
3.96Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	3.65%
3.96Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	3.63%
3.97Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	3.65%
4.37Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	3.68%
4.37Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	3.70%
5.47Y	091800009.IB	18 东方债 01BC(品种二)	AAA	3.71%
6.19Y(休 1)	2280162.IB	22 福清城投绿色债 01	AA+	4.37%

文 / Derek Huang, Ethan Yuan, Teddy Chen, Oscar Wu

联系人: Yolanda Fang
邮箱: Yolanda.Fang@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