

收盘日评 银行间债券市场

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2026-01-28】

国债

今日央行开展 3775 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 3635 亿，逆回购口径资金净投放 140 亿。

国债方面 2.08Y 250005 1.3575-1.3575； 3.99Y 250003 1.51-1.52； 6.15Y 250007 1.646-1.66； 9.57Y 250016 1.815-1.834； 29.57Y 2500006 2.247-2.265。

	1y	3y	5y	7y	10y	30y
昨日国债(%)	1.2100	1.4000	1.5825	1.6990	1.8310	2.2590
今日国债(%)	1.2150	1.3850	1.5725	1.6880	1.8200	2.2490
变动(%)	0.0050	-0.0150	-0.0100	-0.0110	-0.0110	-0.0100

金融债

金融债方面 8D 250401 1.46-1.50； 3.07Y 240203 1.675-1.685； 5.97Y 220205 1.825-1.8325； 9.39Y 250215 1.951-1.966。

	1y	3y	5y	7y	10y
昨日非国开金融债(%)	1.5400	1.6600	1.7310	1.9025	1.9810
今日非国开金融债(%)	1.5360	1.6500	1.7255	1.9000	1.9750
变动(%)	-0.0040	-0.0100	-0.0055	-0.0025	-0.0060
昨日国开债(%)	1.5200	1.7000	1.7350	1.8850	1.9570
今日国开债(%)	1.5175	1.6950	1.7280	1.8825	1.9525
变动(%)	-0.0025	-0.0050	-0.0070	-0.0025	-0.0045

银行债

5y 大行二级收益率今日开盘后先震荡上行后持续震荡下行。非免税券前收 2.105 (+0.68)，今开 2.105 (+0.68)。日内最高 2.11 (+1.18)，最低 2.10 (+0.18)，震荡区间 1bp，今收 2.10(+0.18)，尾盘对峙为 2.10/2.095。盘中与同期限大行永续相差约 5bp，券商基金为主要参与方；

五年 25 工行二级资本债 02BC 前收 2.02 (+0.14)，今开 2.025(+0.64)，日内最高 2.035(+1.64)，最低 2.015(-0.36)，今收 2.02(+0.14)，尾盘对峙为 2.02/2.0175，市场成交依旧火热；

十年 25 农行二级资本债 03B(BC)昨收 2.455 (+0.31) 今开 2.46(+0.81)，最高 2.46(+0.81)，最低 2.455(+0.31)，今收 2.455(+0.31)，尾盘对峙为 2.4525/2.45；

5y 股份制二永收益上行，尾盘下行。4.83y 平安永续成交在 2.34 (+0.91) 到 2.345 (+1.41)，震荡区间 0.5bp。今日股份制二永成交午后回暖，基金，保险，券商均有参与。

1-3y 大行二级今日成交收益率整体震荡上行，尾盘稍回落，其中 2y 左右大行二级较昨日整体上行 1bp 左右；1y 大行今开 1.695/1.69，最高成交在 1.695 (+0.65)，最低成交在 1.69 (+0.15)，尾盘收在 1.69/1.685。2y 大行今开 1.75/1.74，最高成交在 1.76 (+1.34)，最低成交在 1.75 (+0.34)，尾盘收在 1.755/1.75。今日 1-3y 大行二级交易情绪较平稳，买卖盘力量均衡，基金、理财、券商为主要参与机构。

商金方面，1-3y 大行主要成在 (-1) 到 (+1.5)。股份制主要成在 (-2.5) 到 (+1.5)。2.87y 25 浦发银行 03 成在 1.785 (+0)。大城商行今日主要成在 (-1) 到 (+1)。2.9y 25 江苏银行债 04BC 成在 1.8075 (+0.04)。科创今日成在 (-0.5) 到 (+0.5)。收益率早盘走高，午后持续走低。基金、银行/银行、基金为主。

短期融资券

今日银行间短融市场交投活跃度较好，成交主要集中于 2026Q1Q2 期限。短端方面，28D 072510227.IB 25 光大证券 CP003 AAA 成交在 1.60% (+0.74)，基金出给银行；78D 012680190.IB 26 厦门国贸 SCP003 AAA 成交在 1.71% (-1.09)，券商出给基金。中长端方面，140D 012680161.IB 26 蒙牛 SCP001 AAA 成交在 1.67% (+0.08)，基金出给基金；141D 012582328.IB 25 上海医药 SCP003 AAA 成交在 1.67% (-2.73)，基金出给基金。长端方面，222D 012583017.IB 25 广州环保 SCP004 AAA 成交在 1.70% (+2.48)，银行出给银行。总体而言，短端、中长端和长端收益日内均上行。

中期票据

今日中票收益早盘在估值左右，尾盘收在估值+1 附近。汇金、电网成交活跃度今日较为平淡，5y 汇金今日在 1.9455% (+0.02) 成交。10Y 电网成在 2.295% (+0.71)。

1-3Y，好名字整体成交在估值-1 到估值+2，2.81Y 23 广州地铁 MTN007 成在 1.83% (-0.08)，1.15Y 24 中核 MTN001 成在 1.69% (+0.79)，1.22Y 24 河钢集 MTN005 成在 1.86% (-0.73)。成交收益率集中在 1.8%-2.00%，基金、券商/基金、银行为主。

3-5Y，好名字整体成交在估值-3 到估值+3，3.62Y 24 苏交通 MTN012 成在 1.89% (-0.27)，4.23Y 25 南电 MTN005 成在 1.94% (-0.01)，4.63Y 25 光大集团 MTN006A 成在 1.96% (+0.32)，收益率集中在 1.90%-2.10%，基金/银行为主。

5Y+，5.08Y 24 合建投 MTN002 成在 2.05% (+0.83)；9.88Y 25 诚通控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)成在 2.425% (+0.47)，成交收益率主要集中在 2.30%-2.50%

永续中票集中在 3Y 左右的普通名字，成交收益率大概在估值-5/+2，理财/基金为主

企业债

交易所信用债全天交投非常活跃，基金，券商，保险，理财均有参与。全天收益震荡。

1 年内，券商债成交在估值到估值+1 (356D 24 中证 G2 1.645)，基金理财双边参与；非券商债多成交在 1.66-1.75，(240D(银休 3) 23 皖交 05 1.70)，基金保险理财买，基金券商卖；年内科创债今日成交较少 (329D 25 大唐 SK 1.69)。

1-3 年，今日券商债成交较为活跃，在估值-1 到估值+1 (2.71Y(休 2) 25 中证 G7 1.80)，基金理财买，基金理财卖；非券商债多成交在 1.77-1.87，(2.48Y 23 京资 02 1.80)，基金理财买，基金理财券商卖。科创债成交较少，在估值-2 到估值+1 (2.98Y 26 电投 K1 1.81)。

3-5 年，券商债今日成交寥寥；非券商债方面今日成交较活跃，成交在估值-3 到估值 (4.98Y 26 中化 Y1 2.35)，基金与券商资管双边参与，券商买，保险理财卖；科创方面今日成交尚可，成交多在估值-2 到估值+1 (4.6Y 25 国电 K1 1.9025)，基金券商资管双边参与，券商买，银行保险卖。

5Y+，券商债成交寥寥；非券商债成交较少，(8.77Y 24 中化 16 2.59)，成交多在估值-2 到估值+2 之间，基金券商自营双边参与买卖盘；科创方面亦成交较少，(8.01Y 24 电建 K1 2.26)，成交多在估值+2 附近，基金双边参与买卖盘。

美元债

周三市场较为淡静。城投板块，随近期供给消化，市场再度呈单边买盘态势，此外高收益城投债买盘明显增加，美元与点心城投债需求两旺。地产板块，万科随近期利好消息带动曲线上涨 3-4pt，其余名字变化不大。

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 (%)
15D	012581472.IB	25 粤科金融 SCP003	AAA	1.69
28D	072510227.IB	25 光大证券 CP003	AAA	1.6
37D	042580126.IB	25 成都经开 CP002	BBB+	1.72
66D(休 3)	012582734.IB	25 远东租赁 SCP009	AAA	1.84
78D	012680190.IB	26 厦国贸 SCP003	AAA	1.71
86D	012581801.IB	25 嘉公路 SCP002	AA+	1.73
114D	012680085.IB	26 华电产融 SCP001	AAA	1.69
114D	012680085.IB	26 华电产融 SCP001	AAA	1.69
140D	012680161.IB	26 蒙牛 SCP001	AAA	1.67
140D	012680161.IB	26 蒙牛 SCP001	AAA	1.67
141D	012582328.IB	25 上海医药 SCP003	AAA	1.67
141D	042580309.IB	25 建安投资 CP003	AA+	1.76
177D	072510158.IB	25 光大证券 CP001	AAA	1.62
211D	012583007.IB	25 苏交通 SCP029	AAA	1.65
222D	012583017.IB	25 广州环保 SCP004	AAA	1.7
222D	012583017.IB	25 广州环保 SCP004	AAA	1.7
234D(休 1)	012583130.IB	25 福州城投 SCP004	AAA	1.72

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 (%)
27D+1.98Y	102380216.IB	23 黄冈城投 MTN002	AA+	2.01 到期
48D	102380573.IB	23 张家国资 MTN002	AAA	1.67
61D	102380749.IB	23 日照高新 MTN001	AA+	1.82
76D	102380880.IB	23 金桥集团 MTN001	AAA	1.76
125D	102381285.IB	23 灵山 MTN001	AA+	1.72
138D+363D(休 1)	102482242.IB	24 鲁商 MTN003	BBB+	2.23 行权
181D	102381886.IB	23 红豆 MTN001(科创票据)	AA+	2.45
181D	102381886.IB	23 红豆 MTN001(科创票据)	AA+	2.45
198D+2Y	102382058.IB	23 兴城人居 MTN003	AA	1.72 行权
198D+2Y	102382058.IB	23 兴城人居 MTN003	AA	1.72 行权
198D	102382059.IB	23 晋江国资 MTN002	AAA	1.73
208D	102101650.IB	21 成交投 MTN001	AAA	1.7
209D	102382234.IB	23 溧水城建 MTN003	AA+	1.735

209D	102382234.IB	23 溧水城建 MTN003	AA+	1.735
212D+NY	102382264.IB	23 华润 MTN004	AAA	1.73 行权
213D(休 2)	102485196.IB	24 云投 MTN020	AAA	1.77
213D(休 2)	102485196.IB	24 云投 MTN020	AAA	1.77
214D(休 1)	102101737.IB	21 武侯资本 MTN002	AA+	1.75
242D(休 1)	102101966.IB	21 平湖城投 MTN003	AA+	1.75
258D	102102034.IB	21 华润 MTN002	AAA	1.66
271D+1.99Y	102382855.IB	23 常德经建 MTN004	AA+	1.78 行权
281D	102484812.IB	24 滨建投 MTN014	AAA	1.8
292D	102383055.IB	23 南昌建投 MTN007	AAA	1.7
293D	102383069.IB	23 芜湖建设 MTN005	AAA	1.74
293D	102383069.IB	23 芜湖建设 MTN005	AAA	1.74
294D	102484936.IB	24 云建投 MTN017	AAA	1.84
361D(休 1)	102480267.IB	24 保利发展 MTN001A	AAA	2.3
1.07Y	132280013.IB	22 金融城建 GN001(可持续挂钩)	AA	1.79
1.1Y(休 2)	102480680.IB	24 新中泰集 MTN001B	AA+	2.4
1.1Y+3Y	102580933.IB	25 中冶置业 MTN001	AAA	3.00 行权
1.1Y+3Y	102580933.IB	25 中冶置业 MTN001	AAA	3.00 行权
1.13Y	102480900.IB	24 苏国资 MTN003	AAA	1.7325
1.15Y	102481115.IB	24 中核 MTN001	AAA	1.69
1.16Y	102481280.IB	24 深圳特发 MTN002	AAA	1.75
1.19Y	102280739.IB	22 津渤海 MTN002	AAA	1.99
1.19Y	102280739.IB	22 津渤海 MTN002	AAA	1.99
1.19Y	102481360.IB	24 广新控股 MTN001	AAA	1.73
1.2Y(休 2)	102481391.IB	24 大连港 MTN002A	AAA	1.83
1.24Y	102280985.IB	22 高创投资 MTN002	AA+	1.84
1.3Y	102400752.IB	24 邮政 MTN001	AAA	1.7
1.3Y	102400752.IB	24 邮政 MTN001	AAA	1.7
1.32Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	1.7
1.32Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	1.7
1.32Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	1.7
1.49Y+NY	102483198.IB	24 南山开发 MTN002	AAA	1.95 行权
1.49Y+NY	102483198.IB	24 南山开发 MTN002	AAA	1.95 行权
1.56Y	102483612.IB	24 邮政 MTN005	AAA	1.735
1.56Y	102483612.IB	24 邮政 MTN005	AAA	1.735
1.65Y	102484232.IB	24 豫航空港 MTN020	AAA	1.96
1.67Y	102282177.IB	22 武汉城投 MTN001	AAA	1.8
1.73Y+2Y(休 1)	102484477.IB	24 水发集团 MTN010	AAA	2.28 行权
1.73Y+NY(休 2)	102584423.IB	25 晋能煤业 MTN015	AAA	1.99 行权
1.73Y+NY(休 2)	102584423.IB	25 晋能煤业 MTN015	AAA	1.99 行权
1.75Y	102484674.IB	24 格力 MTN005	AAA	1.92
1.75Y+NY	102584517.IB	25 潞安 MTN005	AAA	1.98 行权
1.8Y+NY	102484919.IB	24 鲁高速 MTN008	AAA	1.87 行权
1.8Y+NY	102584791.IB	25 潞安 MTN006A	AAA	2 行权
1.82Y	102584925.IB	25 蓝星 MTN006	AAA	1.87
1.83Y+NY(休 2)	102485144.IB	24 京能洁能 MTN002	AAA	1.88 行权
1.87Y(休 1)	132480166.IB	24 华能集 GN001(碳中和债)	AAA	1.73
1.91Y(休 1)	102485567.IB	24 株洲城建 MTN004A	AA+	1.92
1.95Y+2Y	102580059.IB	25 嘉善高新 MTN001A	AA+	1.96 行权
1.95Y+2Y	102580059.IB	25 嘉善高新 MTN001A	AA+	1.96 行权
1.95Y(休 1)	102580113.IB	25 深圳高速 MTN001	AAA	1.79
1.95Y	102380028.IB	23 广州高新 MTN001	AAA	1.87
1.95Y	102580168.IB	25 杭商贸 MTN001	AAA	1.815
1.96Y	102580198.IB	25 园博园 MTN001	AA	2.095

1.97Y+4Y(休 1)	102380129.IB	23 衡阳交通 MTN001	AA	1.96 行权
1.98Y(休 2)	102580403.IB	25 南山开发 MTN001	AAA	1.97
1.99Y	102580499.IB	25 赣州建投 MTN001A	AA+	2.05
2.01Y(休 1)	102480398.IB	24 武汉城投 MTN001	AAA	1.84
2.07Y	102580723.IB	25 新投 MTN001	AAA	1.96
2.07Y	102580744.IB	25 汇金 MTN002	AAA	1.78
2.07Y	102580744.IB	25 汇金 MTN002	AAA	1.78
2.07Y	102580744.IB	25 汇金 MTN002	AAA	1.78
2.07Y	102580744.IB	25 汇金 MTN002	AAA	1.78
2.07Y	102580744.IB	25 汇金 MTN002	AAA	1.78
2.11Y	102501233.IB	25 贵州交通 MTN001	AAA	2.04
2.12Y	102581084.IB	25 新海连 MTN004	AA+	1.95
2.16Y+2Y	102581408.IB	25 镜湖开发 MTN001A	AAA	1.87 行权
2.2Y	102581500.IB	25 中交城投 MTN001	AAA	1.99
2.2Y	102581500.IB	25 中交城投 MTN001	AAA	1.99
2.31Y(休 1)	102582100.IB	25 中石化 MTN004(科创债)	AAA	1.805
2.31Y(休 1)	102582100.IB	25 中石化 MTN004(科创债)	AAA	1.805
2.31Y(休 1)	102582100.IB	25 中石化 MTN004(科创债)	AAA	1.805
2.31Y(休 1)	102582100.IB	25 中石化 MTN004(科创债)	AAA	1.805
2.36Y	102582267.IB	25 汇金 MTN004	AAA	1.8
2.36Y	102582267.IB	25 汇金 MTN004	AAA	1.8
2.36Y	102582267.IB	25 汇金 MTN004	AAA	1.8
2.37Y	102582398.IB	25 招金 MTN001(科创债)	AAA	1.85
2.43Y	102582712.IB	25 荣盛 MTN001(科创债)	AAA	2.11
2.46Y+NY(休 1)	102582901.IB	25 中电投 MTN017	AAA	1.92 行权
2.54Y	102583459.IB	25 西安城发 MTN001	AAA	1.96
2.59Y+NY	102382332.IB	23 豫交投 MTN007	AAA	2 行权
2.6Y	102583772.IB	25 株洲高科 MTN005	AA+	2.21
2.72Y	102584264.IB	25 宁舟港 MTN002A	AAA	1.84
2.72Y	102584264.IB	25 宁舟港 MTN002A	AAA	1.84
2.77Y	102382989.IB	23 粤交投 MTN006	AAA	1.83
2.79Y(休 1)	102584696.IB	25 东航 MTN005	AAA	1.83
2.79Y(休 1)	102584696.IB	25 东航 MTN005	AAA	1.83
2.83Y(休 1)	102584963.IB	25 山能建工 MTN001	AA	2.16
2.83Y(休 1)	102584963.IB	25 山能建工 MTN001	AA	2.16
2.91Y	102585357.IB	25 光大集团 MTN008	AAA	1.835
2.91Y	102585357.IB	25 光大集团 MTN008	AAA	1.84
2.94Y(休 2)	102680008.IB	26 粤交投 MTN001	AAA	1.845
2.94Y(休 2)	102680008.IB	26 粤交投 MTN001	AAA	1.845
2.94Y(休 2)	102680008.IB	26 粤交投 MTN001	AAA	1.845
2.95Y	102680116.IB	26 云能投 MTN001	AAA	2.19
2.96Y+NY(休 1)	102680147.IB	26 鲁高速 MTN001	AAA	2.01 行权
2.96Y+NY(休 1)	102680147.IB	26 鲁高速 MTN001	AAA	2.02 行权
2.97Y	102601819.IB	26 淄博城资 MTN001	AAA	2.12
2.97Y	102680194.IB	26 深圳地铁 MTN002A	AAA	2.05
2.98Y	102480208.IB	24 扬城建 MTN002	AAA	1.88
2.99Y	102680321.IB	26 赣国资 MTN001(科创债)	AAA	1.895
3Y(休 2)	102680317.IB	26 武进经发 MTN003	AAA	100.00 净价
3Y+NY(休 2)	102680332.IB	26 思明国控 MTN001	AA+	2.29 行权
3.2Y	102481384.IB	24 泸州窖 MTN002	AAA	1.9
3.49Y	102483222.IB	24 兴湘投资 MTN002	AAA	2.14
3.5Y	102483261.IB	24 汇金 MTN005	AAA	1.875
3.53Y	102483393.IB	24 乌城投 MTN005	AAA	1.93
3.53Y	102483463.IB	24 中石集 MTN001	AAA	1.88
3.62Y	102484026.IB	24 苏交通 MTN012	AAA	1.89

3.62Y	102484026.IB	24 苏交通 MTN012	AAA	1.89
3.97Y	102580331.IB	25 石交投集 MTN001B	AAA	2.1
4.08Y	102580860.IB	25 中色 MTN002	AAA	2.04
4.23Y	102581949.IB	25 南电 MTN005	AAA	1.94
4.23Y	102581949.IB	25 南电 MTN005	AAA	1.94
4.47Y(休 2)	102580396.IB	25 电网 MTN011	AAA	1.95
4.47Y(休 2)	102580397.IB	25 电网 MTN010	AAA	1.95
4.47Y(休 2)	102580397.IB	25 电网 MTN010	AAA	1.95
4.47Y(休 2)	102580397.IB	25 电网 MTN010	AAA	1.95
4.47Y(休 2)	102580400.IB	25 电网 MTN008	AAA	1.95
4.48Y	102580451.IB	25 电网 MTN014	AAA	1.95
4.48Y	102583032.IB	25 青岛海控 MTN004	AAA	2.37
4.52Y	102583257.IB	25 江门建设 MTN003	AA	2.32
4.55Y+NY	102583499.IB	25 鄂交投 MTN002	AAA	2.37 行权
4.66Y	102584075.IB	25 上实 MTN004A	AAA	2
4.72Y	102584255.IB	25 乌经开 MTN009	AA+	2.45
4.85Y	102585116.IB	25 上实 MTN005	AAA	2
4.9Y	102585325.IB	25 渝江北嘴 MTN002	AA+	2.28
4.94Y	102680039.IB	26 中燃气 MTN001	AAA	2.47
4.94Y	102680039.IB	26 中燃气 MTN001	AAA	2.47
4.96Y(休 1)	102680130.IB	26 上实 MTN001	AAA	2.01
5Y	102680339.IB	26 嘉善国创 MTN001B	AAA	100.00 净价
5Y	102680347.IB	26 嘉善高新 MTN001	AA+	100.00 净价
5.23Y	102584376.IB	25 电网 MTN033	AAA	1.985
5.23Y	102584376.IB	25 电网 MTN033	AAA	1.985
5.41Y	102585368.IB	25 电网 MTN045(科创债)	AAA	2
5.41Y	102585368.IB	25 电网 MTN045(科创债)	AAA	2
5.54Y	102101505.IB	21 光大集团 MTN001B	AAA	2.035
6.54Y	102281771.IB	22 无锡建投 MTN002	A+	2.27
7.85Y	102383258.IB	23 深投控 MTN004	AAA	2.32
8.1Y(休 1)	102480687.IB	24 苏交通 MTN001	AAA	2.28
9.52Y(休 1)	102583186.IB	25 申迪 MTN002	AAA	2.46

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（%）
89D+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	1.67 行权
89D+NY(休 1)	2128017.IB	21 中信银行永续债	AAA	1.67 行权
111D+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	1.655 行权
111D+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	1.655 行权
133D+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	1.655 行权
133D+NY	2128022.IB	21 交通银行永续债	AAA	1.66 行权
171D(休 2)	212380007.IB	23 上海银行小微债 01	AAA	1.625
178D(休 2)	2320032.IB	23 通商银行 02	AA+	1.7
194D+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	1.67 行权
194D+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	1.67 行权
285D	212380023.IB	23 光大银行债 03	AAA	1.625
292D+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AA+	1.69 行权
292D+NY	2128038.IB	21 农业银行永续债 01	AA+	1.69 行权
301D+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	1.685 行权
301D+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	1.69 行权
301D+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	1.69 行权
301D+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	1.69 行权
301D+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	1.69 行权
303D	212380027.IB	23 华夏银行债 05	AAA	1.625
313D+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	1.705 行权

313D+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	1.705 行权
313D+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	1.705 行权
313D+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	1.71 行权
320D+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	1.72 行权
320D+NY(休 1)	2120110.IB	21 北京银行永续债 02	AAA	1.72 行权
351D+5Y	2228003.IB	22 兴业银行二级 01	AAA	1.70 行权
355D+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	1.69 行权
355D+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	1.69 行权
355D+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	1.69 行权
357D+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.69 行权
357D+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.69 行权
357D+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.69 行权
357D+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.69 行权
1.03Y(休 8)	2428001.IB	24 平安银行小微债 01	AAA	1.67
1.11Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	1.70 行权
1.14Y	2420011.IB	24 浙商银行小微债 01	AAA	1.68
1.15Y+5Y	2220029.IB	22 温州银行二级 02	AAA	1.88 行权
1.16Y+5Y(休 1)	2220030.IB	22 重庆银行二级	AAA	1.765 行权
1.16Y+5Y(休 1)	2220030.IB	22 重庆银行二级	AAA	1.765 行权
1.16Y+5Y(休 1)	2220030.IB	22 重庆银行二级	AAA	1.765 行权
1.2Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	1.71 行权
1.2Y+NY	2228023.IB	22 中国银行永续债 01	AAA	1.71 行权
1.21Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	1.71 行权
1.21Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	1.71 行权
1.21Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	1.71 行权
1.21Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	1.71 行权
1.24Y(休 1)	212400004.IB	24 光大银行小微债	AAA	1.675
1.25Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	AAA	1.715 行权
1.25Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	AAA	1.715 行权
1.25Y+NY	2228029.IB	22 中国银行永续债 02	AAA	1.715 行权
1.3Y	212480011.IB	24 浙商银行小微债 03	AAA	1.69
1.3Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.71 行权
1.3Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.71 行权
1.31Y+1Y(休 2)	312410001.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.71 行权
1.32Y(休 1)	2420018.IB	24 北京银行 03	AAA	1.695
1.32Y	2420019.IB	24 徽商银行 01	AAA	1.6975
1.33Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	1.665
1.41Y(休 2)	222400003.IB	24 渤海银行绿债 01	AAA	1.745
1.52Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.77 行权
1.53Y	2420034.IB	24 厦门国际银行 01	AAA	1.8
1.53Y	2420034.IB	24 厦门国际银行 01	AAA	1.8
1.57Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	1.75 行权
1.57Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	1.75 行权
1.58Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	1.75 行权
1.58Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	1.75 行权
1.58Y+5Y(休 1)	092280080.IB	22 光大银行二级资本债 01A	AAA	1.75 行权
1.59Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	1.75 行权
1.65Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AA+	1.735 行权
1.66Y	212480058.IB	24 交行债 02BC	AAA	1.6825
1.67Y+5Y	092280098.IB	22 杭州银行二级资本债 01	AAA	1.78 行权
1.67Y+5Y	092280098.IB	22 杭州银行二级资本债 01	AAA	1.78 行权
1.74Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	1.755 行权
1.78Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	1.76 行权
1.8Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	1.7575 行权
1.8Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	1.7575 行权

1.8Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	1.7575 行权
1.8Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	1.7575 行权
2.06Y(休 1)	212580003.IB	25 民生银行债 01	AAA	1.73
2.06Y(休 1)	212580003.IB	25 民生银行债 01	AAA	1.74
2.07Y	2520001.IB	25 北京银行小微债 01	AAA	1.7275
2.07Y	2520001.IB	25 北京银行小微债 01	AAA	1.7275
2.07Y	2520001.IB	25 北京银行小微债 01	AAA	1.7275
2.15Y	212500016.IB	25 光大银行债 01	AAA	1.715
2.15Y	212500016.IB	25 光大银行债 01	AAA	1.715
2.16Y(休 2)	212580005.IB	25 上海银行债 01	AAA	1.735
2.16Y(休 2)	212580005.IB	25 上海银行债 01	AAA	1.735
2.16Y	2528006.IB	25 中信银行小微债	AAA	1.72
2.16Y	2528006.IB	25 中信银行小微债	AAA	1.72
2.16Y	2528006.IB	25 中信银行小微债	AAA	1.72
2.2Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA	1.79 行权
2.2Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA	1.79 行权
2.2Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA	1.79 行权
2.2Y+5Y	232380015.IB	23 工行二级资本债 01A	AAA	1.79 行权
2.25Y	2528007.IB	25 浦发银行 01	AAA	1.72
2.33Y+NY	242380007.IB	23 苏州银行永续债 01	AAA	1.9 行权
2.35Y(休 2)	2520016.IB	25 徽商银行 01	AAA	1.76
2.35Y(休 2)	2520016.IB	25 徽商银行 01	AAA	1.76
2.35Y(休 2)	2520016.IB	25 徽商银行 01	AAA	1.76
2.45Y+NY	242300001.IB	23 宁波银行永续债 01	AAA	1.9 行权
2.45Y+1Y	312510006.IB	25 中行 TLAC 非资本债 01(BC)	AAA	1.81 行权
2.45Y+1Y	312510006.IB	25 中行 TLAC 非资本债 01(BC)	AAA	1.81 行权
2.46Y	2520029.IB	25 东莞银行 01	AAA	1.78
2.47Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	1.835 行权
2.48Y(休 1)	222580010.IB	25 华夏银行绿债 01	AAA	1.69
2.56Y+1Y(休 1)	312510012.IB	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	AAA	1.85 行权
2.56Y+1Y(休 1)	312510012.IB	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	AAA	1.85 行权
2.56Y+1Y(休 1)	312510012.IB	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	AAA	1.85 行权
2.56Y+1Y(休 1)	312510012.IB	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	AAA	1.85 行权
2.56Y+1Y(休 1)	312510012.IB	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	AAA	1.85 行权
2.56Y+1Y(休 1)	312510012.IB	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	AAA	1.85 行权
2.63Y+5Y	232380052.IB	23 农行二级资本债 02A	AA+	1.835 行权
2.64Y	212580027.IB	25 上海银行债 02	AAA	1.7825
2.66Y	212580032.IB	25 建行小微债 01BC	AAA	1.76
2.73Y+5Y(休 1)	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A	AAA	1.855 行权
2.74Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.855 行权
2.8Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	1.855 行权
2.8Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	1.86 行权
2.8Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	1.86 行权
2.85Y+5Y	232380084.IB	23 中行二级资本债 04A	AAA	1.855 行权
2.87Y	212580054.IB	25 江西银行债 01	AAA	1.9
2.87Y	212580054.IB	25 江西银行债 01	AAA	1.9
2.87Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.785
2.87Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.785
2.87Y	2528033.IB	25 浦发银行 03	AAA	1.785
2.89Y	212580055.IB	25 渤海银行债 02A	AAA	1.86
3.01Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	1.8775 行权
3.01Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	1.88 行权
3.01Y+5Y	232480001.IB	24 中行二级资本债 01A	AAA	1.88 行权
3.02Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.88 行权
3.02Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.8825 行权

3.02Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.8825 行权
3.02Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.885 行权
3.02Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AA+	1.885 行权
3.19Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	1.895 行权
3.19Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	1.905 行权
3.31Y+1Y	312410002.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01B	AAA	1.89 行权
3.31Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	1.91 行权
3.31Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	1.92 行权
3.35Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AA+	1.945 行权
3.35Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AA+	1.945 行权
3.37Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.025 行权
3.39Y+NY	242480005.IB	24 杭州银行永续债 01	AAA	2.025 行权
3.39Y+NY	242480005.IB	24 杭州银行永续债 01	AAA	2.025 行权
3.39Y+NY	242480005.IB	24 杭州银行永续债 01	AAA	2.025 行权
3.39Y+NY	242480005.IB	24 杭州银行永续债 01	AAA	2.025 行权
3.39Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.025 行权
3.39Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.025 行权
3.44Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	1.9225 行权
3.44Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	1.9225 行权
3.44Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	1.9225 行权
3.44Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	1.925 行权
3.45Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	1.965 行权
3.45Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	1.965 行权
3.49Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	1.935 行权
3.52Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	1.98 行权
3.53Y+5Y	232480050.IB	24 上海银行二级资本债 01	AAA	1.98 行权
3.55Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	1.96 行权
3.56Y+NY	242400018.IB	24 北京农商行永续债 01	AAA	2.12 行权
3.58Y+NY(休 1)	242400019.IB	24 江苏银行永续债 02	AAA	2.065 行权
3.58Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.94 行权
3.58Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	1.955 行权
3.6Y+5Y	232480060.IB	24 盛京银行二级资本债 01	AA+	4.505 行权
3.62Y+NY	242400025.IB	24 北京银行永续债 01	AAA	2.07 行权
3.66Y+NY	232480067.IB	24 华夏银行永续债 02	AAA	2.08 行权
3.66Y+NY	232480067.IB	24 华夏银行永续债 02	AAA	2.08 行权
3.66Y+NY	232480067.IB	24 华夏银行永续债 02	AAA	2.08 行权
3.66Y+NY	232480067.IB	24 华夏银行永续债 02	AAA	2.08 行权
3.75Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	1.9625 行权
3.75Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	1.965 行权
3.75Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	1.965 行权
3.75Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	1.965 行权
3.75Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	1.965 行权
3.75Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	1.97 行权
3.77Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	2.07 行权
3.77Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	2.07 行权
3.77Y+NY	242480070.IB	24 招行永续债 01BC	AAA	2.07 行权
3.83Y+5Y(休 1)	092403004.IB	24 进出口行二级资本债 01A		1.945 行权
3.83Y+NY	242480082.IB	24 农行永续债 03BC	AA+	2.035 行权
3.87Y+5Y(休 1)	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A	AAA	2.00 行权
3.87Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	AAA	2.04 行权
3.87Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	AAA	2.04 行权
3.92Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.9875 行权
3.92Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.99 行权
3.92Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.99 行权
3.92Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.99 行权

3.92Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.99 行权
3.92Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.99 行权
3.92Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	1.99 行权
3.99Y	2528002.IB	25 农业银行三农债 02	AA+	1.805
4.09Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.005 行权
4.09Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.005 行权
4.1Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	2.2125 行权
4.1Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	2.2125 行权
4.1Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	2.2125 行权
4.1Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	2.2125 行权
4.1Y+NY	242580003.IB	25 平安银行永续债 01BC	AAA	2.2125 行权
4.16Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.015 行权
4.16Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.015 行权
4.21Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.18 行权
4.24Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC	AAA	2.155 行权
4.24Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC	AAA	2.155 行权
4.24Y+NY	242580007.IB	25 兴业银行永续债 01BC	AAA	2.155 行权
4.24Y+5Y	232580006.IB	25 民生银行二级资本债 01	AAA	2.2525 行权
4.25Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.155 行权
4.25Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.155 行权
4.25Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.155 行权
4.25Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.155 行权
4.25Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.155 行权
4.25Y+NY	242580008.IB	25 招商银行永续债 01BC	AAA	2.155 行权
4.25Y+NY	242580009.IB	25 湖南银行永续债 01	AAA	2.3 行权
4.25Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.03 行权
4.25Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.03 行权
4.29Y+NY	242580011.IB	25 工行永续债 01BC	AAA	2.11 行权
4.3Y+5Y(休 2)	232580009.IB	25 中信银行二级资本债 01BC	AAA	2.06 行权
4.3Y+5Y(休 2)	232580009.IB	25 中信银行二级资本债 01BC	AAA	2.0625 行权
4.31Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.2 行权
4.31Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.2 行权
4.31Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.2 行权
4.31Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.2 行权
4.31Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.2 行权
4.31Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.2 行权
4.31Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.2 行权
4.31Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.2 行权
4.32Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.0375 行权
4.33Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC	AAA	2.16 行权
4.37Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.1725 行权
4.37Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.1725 行权
4.37Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.1725 行权
4.37Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.1725 行权
4.37Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.175 行权
4.37Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.175 行权
4.38Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AA+	2.0375 行权
4.45Y+NY	242580026.IB	25 浦发银行永续债 02	AAA	2.185 行权
4.48Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.14 行权
4.63Y+NY	242580042.IB	25 宁波银行永续债 01	AAA	2.285 行权
4.64Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.25 行权
4.64Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.105 行权
4.64Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.1075 行权
4.64Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.1075 行权
4.64Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.1075 行权
4.64Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.11 行权
4.64Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.11 行权

4.64Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AA+	2.11 行权
4.65Y+5Y	2028039.IB	20 中国银行二级 02	AAA	2.0725 行权
4.65Y+5Y	2028039.IB	20 中国银行二级 02	AAA	2.0725 行权
4.65Y+5Y	2028039.IB	20 中国银行二级 02	AAA	2.0725 行权
4.65Y+5Y	2028039.IB	20 中国银行二级 02	AAA	2.0725 行权
4.75Y+5Y	232580040.IB	25 湖南银行二级资本债 01	AAA	2.35 行权
4.75Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AA+	2.195 行权
4.78Y+5Y(休 2)	232580041.IB	25 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.385 行权
4.78Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.195 行权
4.78Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.195 行权
4.78Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.195 行权
4.78Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.195 行权
4.79Y+NY	242580048.IB	25 长沙银行永续债 01	AAA	2.4 行权
4.79Y+NY	242580048.IB	25 长沙银行永续债 01	AAA	2.4 行权
4.79Y+NY	242580048.IB	25 长沙银行永续债 01	AAA	2.4 行权
4.81Y+5Y	232580044.IB	25 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.1725 行权
4.81Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+	2.125 行权
4.81Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+	2.125 行权
4.81Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AA+	2.125 行权
4.81Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.34 行权
4.81Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.34 行权
4.81Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.34 行权
4.81Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.345 行权
4.81Y+NY	242580054.IB	25 平安银行永续债 02BC	AAA	2.345 行权
4.83Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.115 行权
4.83Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.115 行权
4.83Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.115 行权
4.83Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.115 行权
4.83Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.116 行权
4.83Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.116 行权
4.83Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.116 行权
4.83Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.116 行权
4.83Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.125 行权
4.83Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.1275 行权
4.84Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.3125 行权
4.84Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.3125 行权
4.85Y+5Y	232580053.IB	25 成都农商行二级资本债 01	AAA	2.305 行权
4.86Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.12 行权
4.86Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.1275 行权
4.86Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.1275 行权
4.86Y+5Y(休 1)	232580055.IB	25 徽商银行二级资本债 01	AAA	2.305 行权
4.88Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.2425 行权
4.88Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.2425 行权
4.88Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.2425 行权
4.88Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.245 行权
4.88Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.246 行权
4.9Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.115 行权
4.9Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.115 行权
4.9Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.115 行权
4.9Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.115 行权
4.9Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.1175 行权
4.9Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.1275 行权
4.9Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.13 行权
5.14Y+5Y	2128009.IB	21 中国银行二级 02	AAA	2.11 行权
5.78Y+5Y(休 1)	2128034.IB	21 建设银行二级 04	AAA	2.18 行权

5.88Y+5Y	2128052.IB	21 工商银行二级 03	AAA	2.19 行权
8.02Y+5Y(休 1)	232480005.IB	24 农行二级资本债 01B	AA+	2.34 行权
8.24Y+5Y	232480012.IB	24 农行二级资本债 02B	AA+	2.355 行权
8.24Y+5Y	232480012.IB	24 农行二级资本债 02B	AA+	2.36 行权
8.24Y+5Y	232480012.IB	24 农行二级资本债 02B	AA+	2.3613 行权
8.24Y+5Y	232480012.IB	24 农行二级资本债 02B	AA+	2.3613 行权
8.24Y+5Y	232480012.IB	24 农行二级资本债 02B	AA+	2.3613 行权
8.24Y+5Y	232480012.IB	24 农行二级资本债 02B	AA+	2.3613 行权
8.24Y+5Y	232480012.IB	24 农行二级资本债 02B	AA+	2.3613 行权
8.44Y+5Y	232480034.IB	24 建行二级资本债 02B	AAA	2.36 行权
8.44Y+5Y	232480034.IB	24 建行二级资本债 02B	AAA	2.365 行权
8.44Y+5Y	232480034.IB	24 建行二级资本债 02B	AAA	2.37 行权
8.44Y+5Y	232480034.IB	24 建行二级资本债 02B	AAA	2.37 行权
9.64Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AA+	2.455 行权
9.64Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AA+	2.455 行权
9.64Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AA+	2.46 行权
12D	148180.SZ	23 华股 01	AAA	1.62
14D+67D(休 1)	137173.SH	23 山金 EB	AAA	170.00 净价
37D	138996.SH	23 平证 04	AAA	1.62
41D	257699.SH	25 漯河 D1	AA	1.89
47D+2Y	032380236.IB	23 沪地产 PPN001	AAA	1.71 行权
50D	032100350.IB	21 临沂城发 PPN001	AA+	1.76
56D	178187.SH	21 柳城 02	AA+	2.08
89D+2Y	250859.SH	23 宣汉 V2	AA	1.82 行权
117D	115124.SH	23 三友 01	AA+	1.75
117D	115124.SH	23 三友 01	AA+	1.75
117D	115124.SH	23 三友 01	AA+	1.75
140D	082581167.IB	25 恒润 2 号 ABN001 优先		2.37
146D	152910.SH	21 郑地 03	AAA	1.74
186D(休 1)	196792.SH	21 土地 01	AAA	1.76
188D	115748.SH	23 豫资 03	AAA	1.76
188D	115748.SH	23 豫资 03	AAA	1.76
193D(休 1)	251978.SH	23 射城 01	AA	1.913
211D	188648.SH	21 中泰 03	AAA	1.62
212D	251649.SH	23 泰控 04	AA	2.0664
229D+2Y	188731.SH	21 穗建 04	AAA	1.78 行权
234D(休 1)	280149.SH	25 景城 D2	AA	1.98
234D(休 1)	280149.SH	25 景城 D2	AA	1.98
257D	252647.SH	23 柯桥 01	AA+	1.78
262D(休 2)	133694.SZ	23 诸建 01	AA+	1.79
270D(休 1)	152307.SH	19 金灌 02	AA	1.92
270D(休 1)	152307.SH	19 金灌 02	AA	1.92
270D(休 1)	152307.SH	19 金灌 02	AA	1.92
273D	032481160.IB	24 黄石新投 PPN002B	AA+	2.04
297D(休 2)	253118.SH	23 世博 02	AAA	1.78
313D	240347.SH	23 中金 C1	AAA	1.65
313D	240347.SH	23 中金 C1	AAA	1.65
332D(休 2)	253407.SH	23 崇川 02	AA+	1.79
349D+2Y	240482.SH	24 漳九 01	AAA	1.79 行权
355D	253608.SH	24 银河 F1	AAA	1.66
356D	240505.SH	24 中证 G2	AAA	1.645
1.07Y+NY	092280003.IB	22 中国信达债 01	AAA	1.84 行权
1.07Y+NY	092280003.IB	22 中国信达债 01	AAA	1.84 行权
1.07Y+NY	092280003.IB	22 中国信达债 01	AAA	1.84 行权

1.08Y	240600.SH	24 中泰 02	AAA	1.66
1.09Y	2422004.IB	24 兴业消费金融债 01	AAA	1.72
1.1Y+NY(休 1)	185454.SH	22 信投 Y1	AAA	1.73 行权
1.13Y+5Y	2223002.IB	22 工银安盛人寿	AAA	1.77 行权
1.16Y+2Y	254246.SH	24 滨湖 K1	AA	1.87 行权
1.17Y+2Y(休 1)	133812.SZ	24 罗投控 01	AAA	1.82 行权
1.23Y+NY	148709.SZ	24 锡公 Y1	AAA	1.8 行权
1.29Y	242603.SH	25 招证 K1	AAA	1.68
1.29Y	242897.SH	25 平证 K1	AAA	1.69
1.29Y	242897.SH	25 平证 K1	AAA	1.69
1.29Y	242897.SH	25 平证 K1	AAA	1.69
1.29Y	242566.SH	25 中证 K1	AAA	1.68
1.3Y+2Y	240996.SH	24 紫金 K1	A-	1.73 行权
1.31Y	240998.SH	24 国君 G1	AAA	1.69
1.34Y	184409.SH	22 汉江 01	AAA	1.765
1.34Y	184409.SH	22 汉江 01	AAA	1.765
1.34Y	185852.SH	22 兴城 03	AAA	1.77
1.35Y+2Y	241067.SH	24 环球 04	AAA	1.86 行权
1.38Y	194686.SH	22 荷城 01	AA+	1.98
1.4Y+2Y(休 1)	185917.SH	22 穗建 06	AAA	1.92 行权
1.4Y+NY	185926.SH	22 济建 Y3	AAA	1.81 行权
1.45Y+NY(休 1)	185388.SH	22 华泰 Y2	AAA	1.76 行权
1.49Y	194678.SH	22 泉港 01	AA+	1.89
1.49Y	194678.SH	22 泉港 01	AA+	1.89
1.49Y	194678.SH	22 泉港 01	AA+	1.89
1.49Y	194678.SH	22 泉港 01	AA+	1.89
1.51Y+NY(休 1)	137588.SH	22 鄂交 Y6	AAA	1.77 行权
1.51Y+NY(休 1)	137588.SH	22 鄂交 Y6	AAA	1.77 行权
1.51Y+NY(休 1)	137588.SH	22 鄂交 Y6	AAA	1.77 行权
1.51Y+NY(休 1)	137588.SH	22 鄂交 Y6	AAA	1.77 行权
1.53Y+2Y	2280353.IB	22 诸新绿色债 01	AA	1.85 行权
1.56Y(休 2)	243544.SH	25GTHT07	AAA	1.74
1.56Y(休 2)	243544.SH	25GTHT07	AAA	1.74
1.58Y	149613.SZ	21 广开 03	AAA	1.88
1.65Y	241649.SH	24 杭城 03	AAA	1.77
1.73Y	280310.SH	25 信投 F3	AAA	1.87
1.73Y+NY	137971.SH	22 葛洲 Y5	AAA	1.82 行权
1.73Y+NY	137971.SH	22 葛洲 Y5	AAA	1.82 行权
1.77Y+2Y(休 1)	256288.SH	24 杭开 01	AA+	1.90 行权
1.83Y	256579.SH	24 余城 02	AAA	1.9
1.84Y+2Y(休 1)	256716.SH	24 开城 03	AA+	2.30 行权
1.85Y	256330.SH	24 萍资 01	AA	2.26
1.86Y	256790.SH	24 蚌资 04	AA+	2.18
2.13Y+NY	115051.SH	中核 YK02	AAA	1.75 行权
2.19Y	524204.SZ	25 国证 04	AAA	1.75
2.22Y+NY	148253.SZ	23 广发 Y2	AAA	1.94 行权
2.22Y+NY	148253.SZ	23 广发 Y2	AAA	1.94 行权
2.22Y+NY	148253.SZ	23 广发 Y2	AAA	1.94 行权
2.23Y+6Y(休 2)	134226.SZ	25 台商 01	AA	2.06 行权
2.24Y	242840.SH	25 华创 C1	AAA	2.23
2.24Y	258431.SH	25 临城 01	AAA	2.03
2.25Y(休 5)	242891.SH	25 济控 01	AAA	2.15
2.4Y	243211.SH	25 电投 K4	AAA	1.79
2.45Y	188329.SH	21 锡建 04	A+	1.85
2.48Y	115682.SH	23 京资 02	AAA	1.8

2.54Y	243555.SH	25 光证 G3	AAA	1.85
2.54Y(休 2)	524370.SZ	25 中海 03	AAA	2.4
2.57Y	252073.SH	23 两江 06	AAA	2.05
2.62Y+2Y	259945.SH	25 昌新 02	AA	2.19 行权
2.71Y(休 2)	243912.SH	25 中证 G7	AAA	1.8
2.72Y+NY	524460.SZ	25 蜀道 KY4	AAA	1.99 行权
2.72Y+NY	524460.SZ	25 蜀道 KY4	AAA	1.99 行权
2.72Y+NY	524460.SZ	25 蜀道 KY4	AAA	1.99 行权
2.73Y+NY	240109.SH	23 华泰 Y2	AAA	1.94 行权
2.75Y	280464.SH	25 合投 K2	AAA	2
2.76Y	252681.SH	23 石发 05	AAA	2.08
2.77Y	134600.SZ	25 小岗 01	BBB	2.32
2.77Y	134600.SZ	25 小岗 01	BBB	2.32
2.79Y+NY	524532.SZ	25 蜀道 KY6	AAA	1.99 行权
2.79Y+NY	524532.SZ	25 蜀道 KY6	AAA	1.99 行权
2.79Y+NY	524532.SZ	25 蜀道 KY6	AAA	1.99 行权
2.82Y	244229.SH	25 华泰 17	AAA	1.815
2.83Y(休 2)	244289.SH	25 北控 K5	AAA	1.8
2.83Y(休 2)	244289.SH	25 北控 K5	AAA	1.8
2.83Y(休 1)	524555.SZ	25 蛇口 04	AAA	2.35
2.83Y(休 1)	524555.SZ	25 蛇口 04	AAA	2.35
2.88Y	148550.SZ	23 国证 13	AAA	1.79
2.92Y+NY	282380006.IB	23 建信人寿永续债 01	AAA	2.07 行权
2.92Y+NY	282380006.IB	23 建信人寿永续债 01	AAA	2.07 行权
2.98Y(休 2)	281239.SH	26 定海 01	AA	2.28
2.98Y	244586.SH	26 电投 K1	AAA	1.81
2.98Y	244586.SH	26 电投 K1	AAA	1.81
2.99Y+2Y(休 1)	281328.SH	26 安新 01	AA+	2.24 行权
3.38Y+NY(休 2)	241120.SH	陕煤 KY09	AAA	1.97 行权
3.44Y(休 1)	255232.SH	24 新余 04	AA	2.37
3.44Y(休 1)	255232.SH	24 新余 04	AA	2.37
3.44Y	241207.SH	24 鲁金 02	AAA	2.11
3.88Y	524074.SZ	24 长城 C3	AAA	2.11
3.88Y	524074.SZ	24 长城 C3	AAA	2.11
4.24Y+NY	242870.SH	25 中化 Y3	AAA	2.28 行权
4.24Y+NY	242870.SH	25 中化 Y3	AAA	2.28 行权
4.37Y	243114.SH	25CMGK01	AAA	1.89
4.37Y	243114.SH	25CMGK01	AAA	1.89
4.6Y	243706.SH	25 国电 K1	AAA	1.9025
4.6Y	243706.SH	25 国电 K1	AAA	1.9025
4.6Y	243706.SH	25 国电 K1	AAA	1.9025
4.77Y+NY	244155.SH	25 佛建 Y2	AAA	2.44 行权
4.82Y	244290.SH	25 北控 K6	AAA	1.92
4.83Y	524561.SZ	25 粤环 GK3	AAA	1.98
4.83Y	524561.SZ	25 粤环 GK3	AAA	1.98
4.98Y+NY(休 1)	244562.SH	26 中化 Y1	AAA	2.35 行权
4.98Y+NY(休 1)	244562.SH	26 中化 Y1	AAA	2.35 行权
4.98Y+NY(休 1)	244562.SH	26 中化 Y1	AAA	2.35 行权
4.98Y+NY(休 1)	244562.SH	26 中化 Y1	AAA	2.355 行权
5.08Y	253923.SH	24 常城 03	AAA	2.26
8.01Y	240573.SH	24 电建 K1	AAA	2.26
8.01Y	240573.SH	24 电建 K1	AAA	2.26
20.79Y	121614.SZ	零碳 3 优		2.42

免责声明：本日报由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用日报内容。日报所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，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，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本日报任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。