



【2025-12-24】

国债

今日央行开展 260 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 468 亿，逆回购口径资金净回笼 208 亿。

国债方面 22D 250001 1.19-1.20； 2.17Y 250005 1.315-1.32； 4.09Y 250003 1.5225-1.53； 6.25Y 250007 1.6525-1.66； 9.67Y 250016 1.8315-1.84； 29.67Y 2500006 2.208-2.229。

	1y	3y	5y	7y	10y	30y
昨日国债(%)	1.3400	1.3550	1.5800	1.7020	1.8370	2.2235
今日国债(%)	1.3350	1.3500	1.5825	1.6940	1.8375	2.2200
变动(%)	-0.0050	-0.0050	0.0025	-0.0080	0.0005	-0.0035

金融债

金融债方面 20D 250301 1.32-1.335； 3.16Y 240203 1.67-1.6725； 6.07Y 220205 1.845-1.855； 9.48Y 250215 1.89-1.904。

	1 y	3y	5y	7y	10y
昨日非国开金融债(%)	1.5225	1.6350	1.7225	1.9250	1.9750
今日非国开金融债(%)	1.5300	1.6350	1.7250	1.9350	1.9780
变动(%)	0.0075	0.0000	0.0025	0.0100	0.0030
昨日国开债(%)	1.5000	1.6925	1.7100	1.9025	1.8980
今日国开债(%)	1.5000	1.6925	1.7100	1.9000	1.8990
变动(%)	0.0000	0.0000	0.0000	-0.0025	0.0010

银行债

1-3y 大行二级今日成交收益率整体上行；1y 大行今开 1.765/1.76，成交在 1.76（+0.03）和 1.755（-0.47），尾盘收在 1.755/1.75。2y 大行今开 1.86/1.84，成交在 1.855（+0.62）和 1.86（+1.12），尾盘收在 1.855/1.85。今日 1-3y 大行二级交易情绪一般，卖盘力量较强于买盘，基金、券商资管以及理财为主要参与机构。

5y 股份制二永收益率整体下行。4.98y 华夏永续成交在 2.37（+0.43）到 2.38（+1.43），震荡区间 1bp。今日股份制二永成交情绪一般，基金，理财，券商有参与。

商金方面，1-3y 大行主要成在（-1.5）到（+0.5）。股份制主要成在（-1）到（+1）。2.34y 25 浦发银行 01 成在 1.77（-0.27）。大城商行今日主要成在（-1）到（+1）。3y 25 江苏银行债 04BC 成在 1.86（+0.11）到 1.861（+0.21）。科创今日主要成在（-0.5）到（+1.5）。收益率持续在估值上下动荡。银行、基金/ 基金、银行为主。

短期融资券

今日银行间短融市场交投活跃度一般，成交主要集中于 2026Q1 期限。短端方面，30D 012582898.IB 25 龙源电力 SCP010 AAA 成交在 1.66%（-1.01），银行出给基金；88D（休 1）012581780.IB 25 电网 SCP020 AAA 成交在 1.65%（+0.50），基金出给银行。中长端方面，127D 012583117.IB 25 中交投 SCP005 AAA 成交在 1.74%（+0.85），理财出给银行；110D 012581707.IB 25 物产中大 SCP006 AAA 成交在 1.70%（-0.05），基金出给基金；长端方面，254D 012582993.IB 25 华友钴业 SCP008 AA+ 成交在 2.28%（-0.29），资管出给银行。总体而言，短端、中长端和长端收益日内震荡。

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、电网成交今日较为活跃，5y 汇金今日在 2.00%（-0.16）成交。汇金电网价差 0.5bp，10Y 电网今日成在 2.37（-0.9）

1-3Y，好名字整体成交在估值-2 到估值+2，1.76Y 22 国新控股 MTN003(能源保供特别债)成在 1.80%（+0.13），1.63Y 22 湖州城投 MTN003(可持续挂钩)成在 1.84%（-0.9），2.48Y 24 湘高速 MTN006 成在 1.90%（-2.15）。成交收益率集中在 1.80%-2.10%，银行、基金/ 银行、资管为主。

3-5Y，好名字整体成交在估值-2 到+3， 3.2Y 24 国联 MTN003 成在 1.96%（-0.7）， 3.11Y 24 蓉城轨交 MTN002 成在 1.90%（+2.12）， 4.88Y 25 杭州国资 MTN001 成在 2.13%（-4.45），收益率集中在 1.95%-2.05%，保险、基金/保险、券商为主。

5Y+，9.97Y 25 国新控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)成在 2.445%（-0.5）； 9.06Y 25 中化股 MTN001 成在 2.64%（-0.06）， 成交收益率主要集中在 2.40%-2.60%附近，银行/ 保险为主。

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-2/+2，基金、保险/理财为主。

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，基金为主。全天收益下行。

1 年内，券商债成交在估值附近（348D 23 信投 13 1.67），基金理财买，基金券商卖；非券商债多成交在 1.69-1.78，（325D GR 中电 02 1.71)，基金理财保险买，基金保险卖；年内科创债今日成交活跃（317D 23 亦庄 K3 1.63)，基金买，基金券商卖。

1-3 年，今日券商债成交较为活跃，在估值+1 到估值-2（2.95Y 23 信投 14 1.78），基金保险买，基金券商卖；非券商债多成交在 1.78-1.94，（2.9Y 25 唐新 05 1.86），基金保险理财买，基金理财券商卖。科创债成交活跃，在估值-2 到估值（2.95Y 京资 K13 1.78），基金双边参与，保险券商亦有卖出。

3-5 年，券商债今日成交寥寥；非券商债方面今日成交活跃，成交在估值-2.5 到估值+0.5（4.98Y 25 深投 08 2.06），基金双边参与，券商资管买，银行券商理财卖；科创方面今日成交尚可，成交多在估值-2 到估值（4.89Y 建材 K16 1.955），基金双边参与，券商资管买，券商自营保险理财卖。

5Y+，券商债成交寥寥；非券商债成交较多，成交多在估值+1 到估值-1 之间，（7.4Y 23 诚通 12 2.30）基金，券商资管和保险资管双边参与买卖盘；科创方面亦成交较多，成交多在估值-1 附近，（9.91Y 25 诚通 K1 2.39）基金双边参与买卖盘，券商亦有少量卖出。

美元债

周三市场节日氛围浓厚，香港机构多于午后关账。早盘需求集中在点心债方面，买盘集中在 2.1-2.4%投资级券。城投板块与地产板块均整体平稳。

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	012582269.IB	25 中车 SCP005	AAA	1.62
13D	012581043.IB	25 平安点创 SCP002	AA+	1.95
23D	012580960.IB	25 桐昆 SCP002(科创票据)	AA+	1.85
23D	012580960.IB	25 桐昆 SCP002(科创票据)	AA+	1.85
30D	012581735.IB	25 中交一公 SCP006(科创债)	AAA	1.68
30D	012582898.IB	25 龙源电力 SCP010	AAA	1.66
30D	012582898.IB	25 龙源电力 SCP010	AAA	1.66
49D	012581275.IB	25 龙盛 SCP006(科创债)	AAA	1.71
88D(休 1)	012581771.IB	25 电网 SCP021	AAA	1.65
88D(休 1)	012581780.IB	25 电网 SCP020	AAA	1.65
88D(休 1)	012581780.IB	25 电网 SCP020	AAA	1.65
111D	012581707.IB	25 物产中大 SCP006	AAA	1.7
111D	012581707.IB	25 物产中大 SCP006	AAA	1.7
112D	012581745.IB	25 苏州港 SCP003	AA+	1.78
115D(休 2)	012582561.IB	25 电网 SCP036	AAA	1.705
127D	012583117.IB	25 中交投 SCP005	AAA	1.74
254D	012582993.IB	25 华友钴业 SCP008(科创债)	AA+	2.28
257D	012583021.IB	25 冀中能源 SCP017(科创债)	AAA	2

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（%）
10D(休 1)	102282802.IB	22 华靖资产 MTN003	AA+	2.01
88D(休 1)	102380634.IB	23 东南国资 MTN002	AAA	1.72
107D	102380814.IB	23 鲁招金 MTN001(科创票据)	AAA	1.73
107D	102380814.IB	23 鲁招金 MTN001(科创票据)	AAA	1.73
201D+NY(休 2)	102381633.IB	23 华电股 MTN008B	AAA	1.81 行权
201D+NY(休 2)	102381633.IB	23 华电股 MTN008B	AAA	1.81 行权
236D	102382060.IB	23 吉利汽车 MTN001	AAA	1.85
244D+2Y	102382224.IB	23 赣州城投 MTN002	AA+	1.70 行权
247D	102382248.IB	23 宜昌高新 MTN005	AA+	1.83
249D(休 1)	102101730.IB	21 荆门城投 MTN003	AA	1.88
296D+NY	102382701.IB	23 沪电力 MTN001	AAA	1.81 行权

308D	102484681.IB	24 泰达投资 MTN005	AAA	1.9
311D(休 2)	102484747.IB	24 商丘发展 MTN002	AA+	1.96
329D	102484936.IB	24 云建投 MTN017	AAA	1.87
348D+364D	102485281.IB	24 甘国投 MTN008	AAA	1.80 行权
348D+364D	102485281.IB	24 甘国投 MTN008	AAA	1.80 行权
359D+NY	102383372.IB	23 晋能装备 MTN009	AAA	1.88 行权
1.05Y	102480124.IB	24 福州左海 MTN001	AAA	1.78
1.06Y	102280099.IB	22 恒健 MTN001	AAA	1.74
1.06Y	102280099.IB	22 恒健 MTN001	AAA	1.74
1.1Y	102480322.IB	24 浙资运营 MTN001(科创票据)	AAA	1.78
1.25Y	102481154.IB	24 中色 MTN001	AAA	1.8
1.25Y	102481154.IB	24 中色 MTN001	AAA	1.8
1.26Y	102481280.IB	24 深圳特发 MTN002	AAA	1.81
1.31Y	102000670.IB	20 合建投 MTN001	AAA	1.79
1.41Y(休 2)	102481993.IB	24 辽港集团 MTN001A	AAA	1.87
1.47Y	102580033.IB	25 云投 MTN001	AAA	1.98
1.49Y	102482668.IB	24 南航集 MTN001	AAA	1.8
1.54Y(休 2)	102482928.IB	24 云建投 MTN013A	AAA	2.13
1.55Y+NY	102501457.IB	25 晋能煤业 MTN010	AAA	2.12 行权
1.67Y	102400928.IB	24 景德镇陶 MTN004A	AA+	2.13
1.68Y(休 2)	102483859.IB	24 电网 MTN004	AAA	1.78
1.7Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	1.785
1.7Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	1.785
1.7Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	1.785
1.7Y(休 1)	102483985.IB	24 汇金 MTN006	AAA	1.785
1.74Y	102484186.IB	24 福瑞能源 MTN004	AAA	1.82
1.74Y	102484186.IB	24 福瑞能源 MTN004	AAA	1.82
1.74Y	102484199.IB	24 豫航空港 MTN019	AAA	2.03
1.75Y	102484197.IB	24 淮南矿 MTN002	AAA	1.92
1.75Y	102484209.IB	24 龙源电力 MTN004A	AAA	1.825
1.76Y(休 1)	102484250.IB	24 奔驰财务 MTN001A(BC)	AAA	1.94
1.76Y	102282165.IB	22 国新控股 MTN003(能源保供特别债)	AAA	1.8
1.76Y	102282165.IB	22 国新控股 MTN003(能源保供特别债)	AAA	1.8
1.8Y	102282212.IB	22 南电 MTN003	AAA	1.785
1.8Y	102484389.IB	24 国能新能 MTN004	AAA	1.83
1.81Y(休 2)	102584223.IB	25 大唐资本 MTN002	AAA	1.87
1.81Y(休 1)	102282256.IB	22 国盛 MTN003	AAA	1.82
1.82Y	102282266.IB	22 沪国际集 MTN001	AAA	1.81
1.82Y	102282266.IB	22 沪国际集 MTN001	AAA	1.81
1.82Y	102282323.IB	22 烟台财金 MTN001(科创票据)	AA+	1.92
1.87Y+NY(休 2)	132480102.IB	24 郑州地铁 GN002	AAA	1.99 行权
1.93Y+1Y	102585004.IB	25 赣出版 MTN005	AAA	1.87 行权
1.93Y+1Y	102585005.IB	25 赣出版 MTN004	AAA	1.87 行权
1.95Y(休 2)	102485255.IB	24 云投 MTN021B	AAA	2.1
1.95Y+NY(休 2)	102485259.IB	24 洛阳城投 MTN003	AA+	2.31 行权
1.96Y(休 2)	102585198.IB	25 中交建 MTN002	AAA	1.82
1.96Y(休 2)	102585198.IB	25 中交建 MTN002	AAA	1.82
1.97Y+NY(休 1)	102585167.IB	25 鲁西矿业 MTN001	AAA	2.22 行权
1.97Y+NY	102485392.IB	24 赣水投 MTN007	AAA	1.99 行权
1.97Y	102485400.IB	24 山东港口 MTN004	AAA	1.85
1.98Y(休 2)	102485463.IB	24 豫投资 MTN001	AAA	1.85
1.99Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.8125

1.99Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.815
1.99Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.815
2Y+NY	102585324.IB	25 鲁高速 MTN013	AAA	2 行权
2Y+NY	102585324.IB	25 鲁高速 MTN013	AAA	2 行权
2.06Y(休 1)	102580323.IB	25 拜耳 MTN001BC	AAA	2.04
2.16Y	132580018.IB	25 天成租赁 GN001(碳中和债)	AAA	1.91
2.17Y	102580783.IB	25 华能集 MTN002	AAA	1.83
2.17Y	102580783.IB	25 华能集 MTN002	AAA	1.83
2.17Y	102580783.IB	25 华能集 MTN002	AAA	1.83
2.17Y(休 2)	102580806.IB	25 华能集 MTN003	AAA	1.835
2.17Y(休 2)	102580806.IB	25 华能集 MTN003	AAA	1.835
2.18Y	102580876.IB	25 胶州城投 MTN001	AA+	2.17
2.18Y	102580876.IB	25 胶州城投 MTN001	AA+	2.17
2.2Y(休 1)	102580877.IB	25 萍乡投发 MTN001	AA+	2.24
2.25Y+2Y	102501261.IB	25 陕西水发 MTN001	AAA	2.04 行权
2.26Y	102380689.IB	23 浙能源 MTN001	AAA	1.84
2.31Y	102581571.IB	25 淄博城运 MTN001	AAA	2.1
2.4Y	102582089.IB	25 浙能源 MTN002	AAA	1.84
2.4Y	102582089.IB	25 浙能源 MTN002	AAA	1.84
2.4Y	102582089.IB	25 浙能源 MTN002	AAA	1.85
2.46Y	102582279.IB	25 义乌国资 MTN003	AAA	1.91
2.46Y	102582320.IB	25 京国资 MTN005	AAA	1.84
2.48Y(休 1)	102582483.IB	25 京国资 MTN006	AAA	1.84
2.49Y	102582525.IB	25 皖能源 MTN004	AAA	1.85
2.54Y	102582753.IB	25 鄂联投 MTN004A	AAA	2.1
2.68Y	102583682.IB	25 北城建设 MTN001	AA+	2.01
2.77Y(休 9)	102584168.IB	25 闽漳龙 MTN003	AAA	2.08
2.81Y	102584298.IB	25 南航集 MTN004	AAA	1.89
2.83Y	102382821.IB	23 川发展 MTN003	AAA	1.87
2.86Y(休 2)	102584626.IB	25 鲁高速 MTN009	AAA	1.895
2.99Y	102585299.IB	25 豫航空港 MTN007	AAA	2.28
2.99Y	102585299.IB	25 豫航空港 MTN007	AAA	2.28
2.99Y+2Y(休 1)	102585303.IB	25 湖州城投 MTN006	AAA	1.95 行权
2.99Y+2Y(休 1)	102585303.IB	25 湖州城投 MTN006	AAA	1.95 行权
2.99Y	102585309.IB	25 辽成大 MTN001	AA+	3.5
3.26Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	1.9
3.26Y	102481294.IB	24 汇金 MTN001	AAA	1.9
3.4Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	1.9
3.4Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	1.9
3.4Y(休 1)	102481968.IB	24 汇金 MTN003	AAA	1.9
3.59Y(休 1)	102483248.IB	24 荣成经开 MTN001	AA	2.71
3.67Y(休 1)	102483749.IB	24 合建投 MTN004	AAA	1.99
3.68Y	102483897.IB	24 豫航空港 MTN017	AAA	2.47
3.75Y	102484268.IB	24 国盛 MTN003	AAA	1.99
3.75Y	102484268.IB	24 国盛 MTN003	AAA	1.99
4.45Y	102582268.IB	25 汇金 MTN003	AAA	1.995
4.45Y	102582268.IB	25 汇金 MTN003	AAA	1.995
4.45Y	102582268.IB	25 汇金 MTN003	AAA	1.995
4.45Y	102582268.IB	25 汇金 MTN003	AAA	1.995
4.5Y(休 1)	102582545.IB	25 南京地铁 MTN002	AAA	2.01
4.57Y(休 1)	102580430.IB	25 电网 MTN013	AAA	1.995
4.68Y	102583689.IB	25 朝阳国资 MTN002B	AAA	2.14
4.71Y	102583816.IB	25 汇金 MTN005	AAA	2
4.71Y	102583816.IB	25 汇金 MTN005	AAA	2

4.71Y	102583816.IB	25 汇金 MTN005	AAA	2
4.71Y	102583816.IB	25 汇金 MTN005	AAA	2
4.88Y	102501688.IB	25 杭州国资 MTN001	AAA	2.13
4.98Y	102585283.IB	25 粤交投 MTN003	AAA	2.05
6.25Y	102280592.IB	22 中信集团 MTN004B	AAA	2.2
6.32Y	102280824.IB	22 中信集团 MTN005B	AAA	2.2
8.56Y	102483072.IB	24 苏交通 MTN010	AAA	2.36
9.31Y(休 1)	102501315.IB	25 华润 MTN001B	AAA	2.41
9.31Y(休 1)	102501315.IB	25 华润 MTN001B	AAA	2.41
9.9Y	102584816.IB	25 国新控股 MTN002(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.445
9.9Y	102584816.IB	25 国新控股 MTN002(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.445
9.96Y	102585170.IB	25 国新控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.445
9.98Y(休 1)	102585259.IB	25 诚通控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.53
13.83Y	102484558.IB	24 粤电发 MTN005	AAA	2.6
13.83Y	102484558.IB	24 粤电发 MTN005	AAA	2.6

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（%）
26D+5Y(休 1)	2128001.IB	21 渤海银行二级	AAA	1.79 行权
26D+5Y(休 1)	2128001.IB	21 渤海银行二级	AAA	1.79 行权
89D+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	1.66 行权
89D+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	1.66 行权
89D+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	1.66 行权
89D+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	1.66 行权
89D+NY	2128011.IB	21 邮储银行永续债 01	AAA	1.66 行权
125D+NY	2120036.IB	21 台州银行永续债 01	AAA	1.79 行权
126D+5Y	2120038.IB	21 东莞银行二级 02	AAA	1.71 行权
155D+5Y	2120046.IB	21 广州银行二级	AAA	1.72 行权
155D+5Y	2120046.IB	21 广州银行二级	AAA	1.72 行权
157D(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	1.655
157D(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	1.655
157D(休 2)	212380006.IB	23 华夏银行债 02	AAA	1.655
213D(休 2)	212380009.IB	23 长沙银行债 01	AAA	1.665
213D(休 2)	212380009.IB	23 长沙银行债 01	AAA	1.665
278D+5Y(休 2)	2128030.IB	21 交通银行二级	AAA	1.75 行权
278D+5Y(休 2)	2128030.IB	21 交通银行二级	AAA	1.75 行权
299D+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	1.765 行权
299D+NY	2120089.IB	21 北京银行永续债 01	AAA	1.77 行权
306D+5Y(休 1)	2120092.IB	21 徽商银行二级 01	AAA	1.785 行权
306D+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	1.76 行权
320D+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	1.755 行权
320D+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	1.755 行权
320D+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	1.755 行权
322D+5Y	2128036.IB	21 平安银行二级	AAA	1.78 行权
322D+5Y	2128036.IB	21 平安银行二级	AAA	1.78 行权
322D+5Y	2128036.IB	21 平安银行二级	AAA	1.78 行权
322D+5Y	2128036.IB	21 平安银行二级	AAA	1.78 行权
322D+5Y	2128036.IB	21 平安银行二级	AAA	1.78 行权
322D+5Y	2128036.IB	21 平安银行二级	AAA	1.78 行权
322D+5Y	2128036.IB	21 平安银行二级	AAA	1.78 行权
322D+5Y	2128036.IB	21 平安银行二级	AAA	1.78 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权

327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
327D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.755 行权
336D+5Y	2128042.IB	21 兴业银行二级 02	AAA	1.76 行权
337D+5Y	2120105.IB	21 厦门银行二级 02	AAA	1.82 行权
348D+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	1.765 行权
348D+NY	2128047.IB	21 招商银行永续债	AAA	1.765 行权
351D+5Y	2120113.IB	21 吉林银行二级	AAA	102.2447 净价
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
356D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.755 行权
1.07Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.07Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.07Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.07Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.77 行权
1.07Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.77 行权
1.07Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.77 行权
1.07Y+5Y	2228004.IB	22 工商银行二级 01	AAA	1.77 行权
1.16Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	1.785 行权
1.2Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.23Y	212480005.IB	24 光大银行债 01	AAA	1.695
1.23Y	212480005.IB	24 光大银行债 01	AAA	1.695
1.24Y(休 1)	2420013.IB	24 北京银行 01	AAA	1.715
1.24Y(休 1)	2420013.IB	24 北京银行 01	AAA	1.715
1.26Y(休 1)	212480008.IB	24 浦发银行债 02	AAA	1.7
1.3Y(休 1)	212480009.IB	24 上海银行债 01	AAA	1.725
1.3Y(休 1)	212480009.IB	24 上海银行债 01	AAA	1.725
1.3Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	1.785 行权
1.3Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	1.785 行权
1.3Y+5Y	2228024.IB	22 工商银行二级 03	AAA	1.785 行权
1.39Y	212480011.IB	24 浙商银行小微债 03	AAA	1.725
1.39Y	212480011.IB	24 浙商银行小微债 03	AAA	1.725
1.39Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.80 行权
1.39Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.80 行权
1.41Y(休 1)	2420018.IB	24 北京银行 03	AAA	1.725
1.42Y	2420021.IB	24 南京银行 01	AAA	1.73
1.47Y	212480014.IB	24 东莞农商行小微债 01	AAA	1.75
1.5Y(休 2)	2420029.IB	24 威海银行小微债	AAA	1.84

1.5Y(休 2)	2420029.IB	24 威海银行小微债	AAA	1.84
1.62Y(休 1)	212480018.IB	24 湖南银行债 01	AAA	1.805
1.62Y(休 1)	212480018.IB	24 湖南银行债 01	AAA	1.805
1.62Y(休 1)	212480018.IB	24 湖南银行债 01	AAA	1.805
1.62Y(休 1)	212480018.IB	24 湖南银行债 01	AAA	1.805
1.62Y(休 1)	212480018.IB	24 湖南银行债 01	AAA	1.805
1.63Y+1Y(休 2)	312410003.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.815 行权
1.63Y+1Y(休 2)	312410003.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.82 行权
1.66Y+5Y(休 1)	092280065.IB	22 工行二级资本债 03A	AAA	1.83 行权
1.68Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	1.83 行权
1.84Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	1.855 行权
1.84Y	212400011.IB	24 南京银行债 03BC	AAA	1.76
1.84Y	212400011.IB	24 南京银行债 03BC	AAA	1.76
1.87Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	1.855 行权
1.87Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	1.855 行权
1.87Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	1.855 行权
1.87Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	1.855 行权
1.89Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	1.85 行权
1.91Y	2420052.IB	24 赣州银行小微债	AA+	1.885
1.93Y(休 1)	212480073.IB	24 上海银行小微债 01	AAA	1.76
1.94Y+NY	242280002.IB	22 唐山银行永续债 01	AAA	105.0453 净价
2.01Y+5Y	232280012.IB	22 广州银行二级资本债 01	AAA	1.93 行权
2.15Y	212580001.IB	25 浙商银行债 01A	AAA	1.78
2.15Y	212580001.IB	25 浙商银行债 01A	AAA	1.78
2.23Y	212580004.IB	25 恒丰银行债 01	AAA	1.86
2.24Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.895 行权
2.24Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.895 行权
2.24Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.895 行权
2.24Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.895 行权
2.24Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.895 行权
2.24Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.90 行权
2.24Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.90 行权
2.24Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.905 行权
2.24Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.905 行权
2.24Y+5Y	232380006.IB	23 中行二级资本债 01A	AAA	1.905 行权
2.25Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	1.89 行权
2.25Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	1.89 行权
2.25Y	212500016.IB	25 光大银行债 01	AAA	1.765
2.26Y+5Y	232380009.IB	23 建行二级资本债 01A	AAA	1.895 行权
2.26Y+5Y	232380009.IB	23 建行二级资本债 01A	AAA	1.895 行权
2.26Y+5Y	232380009.IB	23 建行二级资本债 01A	AAA	1.90 行权
2.34Y	2528007.IB	25 浦发银行 01	AAA	1.77
2.34Y	2528007.IB	25 浦发银行 01	AAA	1.77
2.48Y	2520018.IB	25 南京银行绿色债 01	AAA	1.65
2.52Y	212580017.IB	25 江苏银行债 02BC	AAA	1.79
2.52Y+1Y(休 2)	312510003.IB	25 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)	AAA	1.905 行权
2.52Y+1Y(休 2)	312510003.IB	25 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)	AAA	1.905 行权
2.58Y(休 1)	222580010.IB	25 华夏银行绿债 01	AAA	1.66
2.58Y(休 1)	222580010.IB	25 华夏银行绿债 01	AAA	1.66
2.68Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.925 行权
2.68Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.925 行权
2.68Y+5Y	232380036.IB	23 工行二级资本债 02A	AAA	1.925 行权
2.72Y+5Y	232380052.IB	23 农行二级资本债 02A	AAA	1.935 行权
2.74Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	1.93 行权

2.74Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	1.93 行权
2.74Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	1.93 行权
2.74Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	1.935 行权
2.74Y+5Y	232380057.IB	23 中行二级资本债 02A	AAA	1.935 行权
2.75Y+5Y(休 1)	232380059.IB	23 东莞银行二级资本债 01	AAA	2.025 行权
2.83Y+5Y(休 1)	232380066.IB	23 中行二级资本债 03A	AAA	1.915 行权
2.84Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.935 行权
2.84Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.935 行权
2.84Y+5Y	232380069.IB	23 建行二级资本债 02A	AAA	1.935 行权
2.9Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	1.92 行权
2.9Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	1.92 行权
2.9Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	1.92 行权
2.9Y+5Y	232380078.IB	23 交行二级资本债 01A	AAA	1.92 行权
2.93Y+5Y(休 1)	232380082.IB	23 浙商银行二级资本债 02	AAA	1.98 行权
2.93Y+5Y(休 1)	232380082.IB	23 浙商银行二级资本债 02	AAA	1.98 行权
2.99Y	212580057.IB	25 江苏银行债 04BC	AAA	1.861
2.99Y	212580057.IB	25 江苏银行债 04BC	AAA	1.861
3.12Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.14 行权
3.12Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.14 行权
3.12Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.15 行权
3.12Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.15 行权
3.12Y+5Y(休 1)	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A	AAA	1.935 行权
3.12Y+5Y(休 1)	232480006.IB	24 建行二级资本债 01A	AAA	1.935 行权
3.25Y+5Y(休 2)	1928007.IB	19 工商银行二级 02	AAA	1.94 行权
3.29Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	1.955 行权
3.3Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AAA	1.95 行权
3.3Y+5Y	1928008.IB	19 农业银行二级 03	AAA	1.95 行权
3.32Y+5Y	232480010.IB	24 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.04 行权
3.33Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.1 行权
3.34Y+5Y	1928012.IB	19 工商银行二级 04	AAA	1.96 行权
3.4Y+1Y	312410002.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01B	AAA	1.975 行权
3.41Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.03 行权
3.44Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.15 行权
3.45Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.075 行权
3.45Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.075 行权
3.45Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.075 行权
3.45Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.075 行权
3.46Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.15 行权
3.49Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.1475 行权
3.54Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.00 行权
3.54Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.00 行权
3.54Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.005 行权
3.54Y+5Y	232480032.IB	24 兴业银行二级资本债 02	AAA	2.05 行权
3.55Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.0925 行权
3.55Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.0925 行权
3.55Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.085 行权
3.55Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.1 行权
3.55Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.1 行权
3.59Y+5Y	232480037.IB	24 交行二级资本债 02A	AAA	2.01 行权
3.61Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.095 行权
3.61Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.095 行权
3.61Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.095 行权
3.61Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.0975 行权
3.61Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.0975 行权
3.61Y+5Y(休 2)	232480039.IB	24 广发银行二级资本债 01A	AAA	2.10 行权

3.63Y+1Y	312410004.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.005 行权
3.63Y+1Y	312410004.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.005 行权
3.63Y+1Y	312410004.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.005 行权
3.63Y+1Y	312410004.IB	24 建行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.005 行权
3.64Y+5Y	1928020.IB	19 交通银行二级 02	AAA	2.02 行权
3.64Y+5Y	1928020.IB	19 交通银行二级 02	AAA	2.02 行权
3.64Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.07 行权
3.64Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.07 行权
3.64Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.0725 行权
3.64Y+5Y	232480052.IB	24 浦发银行二级资本债 01A	AAA	2.075 行权
3.65Y+NY	242400018.IB	24 北京农商行永续债 01	AAA	2.24 行权
3.66Y+5Y	232480054.IB	24 重庆银行二级资本债 01	AAA	2.19 行权
3.68Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.03 行权
3.68Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.0325 行权
3.68Y+5Y	232480061.IB	24 工行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.0325 行权
3.68Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.00 行权
3.68Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.00 行权
3.68Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.005 行权
3.68Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.005 行权
3.68Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.005 行权
3.68Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.005 行权
3.68Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.005 行权
3.68Y+1Y	312410006.IB	24 农行 TLAC 非资本债 01B(BC)	AAA	2.005 行权
3.76Y+NY	232480067.IB	24 华夏银行永续债 02	AAA	2.1975 行权
3.76Y+NY	232480067.IB	24 华夏银行永续债 02	AAA	2.1975 行权
3.84Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	2.055 行权
3.84Y+5Y(休 2)	232480073.IB	24 工行二级资本债 02BC	AAA	2.055 行权
3.87Y+NY	242400031.IB	24 平安银行永续债 01	AAA	2.26 行权
3.87Y+NY	242400031.IB	24 平安银行永续债 01	AAA	2.26 行权
3.96Y+5Y(休 1)	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A	AAA	2.125 行权
3.96Y+5Y(休 1)	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A	AAA	2.13 行权
3.96Y+5Y(休 1)	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A	AAA	2.13 行权
3.96Y+5Y(休 1)	232480098.IB	24 浦发银行二级资本债 02A	AAA	2.13 行权
3.96Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	AAA	2.15 行权
3.96Y+NY	242480086.IB	24 中行永续债 02BC	AAA	2.15 行权
4.02Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	2.0825 行权
4.02Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	2.0825 行权
4.02Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	2.085 行权
4.02Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	2.085 行权
4.02Y+5Y(休 2)	232480106.IB	24 建行二级资本债 03BC	AAA	2.085 行权
4.19Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.10 行权
4.19Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.10 行权
4.19Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.105 行权
4.19Y+5Y(休 2)	232580001.IB	25 工行二级资本债 01BC	AAA	2.105 行权
4.25Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.11 行权
4.25Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.11 行权
4.25Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.115 行权
4.25Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.115 行权
4.25Y+5Y	232580002.IB	25 建行二级资本债 01BC	AAA	2.115 行权
4.3Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.265 行权
4.3Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.265 行权
4.3Y+NY(休 1)	242580004.IB	25 江苏银行永续债 01BC	AAA	2.265 行权

4.35Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.12 行权
4.35Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.125 行权
4.35Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.125 行权
4.35Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.125 行权
4.35Y+5Y	232580008.IB	25 工行二级资本债 02BC	AAA	2.125 行权
4.4Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.28 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.1325 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.1325 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.135 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.1375 行权
4.43Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.43Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.205 行权
4.47Y+NY	242580018.IB	25 江苏银行永续债 02BC	AAA	2.28 行权
4.47Y+NY	242580018.IB	25 江苏银行永续债 02BC	AAA	2.28 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.1375 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.14 行权
4.55Y+5Y(休 2)	232580022.IB	25 工行二级资本债 03BC	AAA	2.14 行权
4.55Y+5Y(休 2)	232580022.IB	25 工行二级资本债 03BC	AAA	2.14 行权
4.55Y+5Y(休 2)	232580022.IB	25 工行二级资本债 03BC	AAA	2.145 行权
4.58Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.21 行权
4.58Y+5Y	232580026.IB	25 建行二级资本债 02A(BC)	AAA	2.14 行权
4.67Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.245 行权
4.72Y+NY	242580038.IB	25 兴业银行永续债 02BC	AAA	2.315 行权
4.73Y+NY	242580042.IB	25 宁波银行永续债 01	AAA	2.35 行权
4.73Y+NY	242580042.IB	25 宁波银行永续债 01	AAA	2.35 行权
4.73Y+NY	242580042.IB	25 宁波银行永续债 01	AAA	2.35 行权
4.73Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.325 行权
4.73Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.325 行权
4.73Y+NY	242580041.IB	25 光大银行永续债 01	AAA	2.325 行权
4.74Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.2025 行权
4.74Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.205 行权
4.74Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.21 行权
4.74Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.21 行权
4.85Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AAA	2.2525 行权
4.85Y+NY	242580045.IB	25 农行永续债 02BC	AAA	2.2525 行权
4.88Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.25 行权
4.88Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.25 行权
4.88Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.25 行权
4.88Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.2525 行权
4.88Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.2525 行权
4.88Y+NY(休 1)	242580047.IB	25 工行永续债 02BC	AAA	2.255 行权
4.89Y+NY	242580048.IB	25 长沙银行永续债 01	AAA	2.48 行权
4.91Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.215 行权
4.91Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.215 行权
4.91Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.91Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.91Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.91Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.91Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.91Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.92Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.21 行权
4.94Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.37 行权

4.94Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.37 行权
4.94Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.375 行权
4.94Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.375 行权
4.94Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.375 行权
4.94Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.375 行权
4.94Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.375 行权
4.94Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.375 行权
4.94Y+NY	242580060.IB	25 华夏银行永续债 01	AAA	2.38 行权
4.96Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.21 行权
4.96Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.21 行权
4.96Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2125 行权
4.96Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2125 行权
4.96Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2125 行权
4.96Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2125 行权
4.96Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2125 行权
4.96Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.215 行权
4.96Y+5Y(休 1)	232580055.IB	25 徽商银行二级资本债 01	AAA	2.40 行权
4.96Y+NY	242580063.IB	25 上海银行永续债 01	AAA	2.395 行权
4.98Y+5Y(休 2)	232580056.IB	25 广发银行二级资本债 01BC	AAA	2.315 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.2225 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.2225 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.2225 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.2225 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.2225 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.2225 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	100.00 净价
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	100.00 净价
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	100.00 净价
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	100.00 净价
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	100.00 净价
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	100.00 净价
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	100.00 净价
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	100.00 净价
6.49Y+5Y(休 1)	2228042.IB	22 农业银行二级 02	AAA	2.33 行权
9.58Y+5Y	232580025.IB	25 农行二级资本债 02B(BC)	AAA	2.4925 行权
9.58Y+5Y	232580025.IB	25 农行二级资本债 02B(BC)	AAA	2.4925 行权
9.58Y+5Y	232580025.IB	25 农行二级资本债 02B(BC)	AAA	2.4925 行权
9.58Y+5Y	232580025.IB	25 农行二级资本债 02B(BC)	AAA	2.4925 行权
9.74Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AAA	2.53 行权
9.74Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AAA	2.53 行权
9.74Y+5Y	232580036.IB	25 农行二级资本债 03B(BC)	AAA	2.53 行权
18D(休 1)	032100023.IB	21 绵阳经开 PPN001	AA	2.3
44D	138862.SH	中电 GK01	AAA	1.6
89D	152789.SH	21 汉江 01	AAA	1.72
89D	152789.SH	21 汉江 01	AAA	1.72
89D	152789.SH	21 汉江 01	AAA	1.72
107D+2Y	133488.SZ	23 皖江 01	AA	2.20 行权
107D+2Y	133488.SZ	23 皖江 01	AA	2.23 行权
121D	115292.SH	23 东证 C1	AAA	1.66
131D(休 2)	032300379.IB	23 沪城控 PPN001	AAA	1.83
131D(休 2)	032300379.IB	23 沪城控 PPN001	AAA	1.83
131D(休 2)	032300379.IB	23 沪城控 PPN001	AAA	1.83
144D(休 1)	185777.SH	22 安租 12	AAA	1.78

144D(休 1)	185777.SH	22 安租 12	AAA	1.78
149D	115373.SH	23 兴业 03	AAA	1.63
151D(休 1)	149479.SZ	21 申证 03	AAA	1.61
151D(休 1)	149479.SZ	21 申证 03	AAA	1.61
153D	251086.SH	23 通城 03	AAA	1.76
176D	115703.SH	23 招证 G8	AAA	1.6
204D+2Y(休 1)	188372.SH	21 保利 08	AAA	2.15 行权
204D+2Y(休 1)	188372.SH	21 保利 08	AAA	2.15 行权
217D+5Y	2123013.IB	21 交银人寿 02	AAA	1.78 行权
222D+3Y	2180300.IB	21 宜宾发展 01	AAA	1.72 行权
234D(休 2)	252005.SH	23 禹城 03	AA	2.25
234D(休 2)	252005.SH	23 禹城 03	AA	2.25
240D	148431.SZ	23 招路 K1	AAA	1.61
240D	251550.SH	23 乐山 02	AA	1.98
243D+1.99Y	252009.SH	23 产控 02	AA+	1.84 行权
243D	524418.SZ	25 广 D10	AAA	1.7
244D	243667.SH	25 管网 SK	AAA	1.58
244D	243667.SH	25 管网 SK	AAA	1.58
279D	243861.SH	25 中证 G4	AAA	1.7
292D+2Y	252616.SH	23 国控 02	AAA	1.88 行权
300D	115955.SH	23 兴业 C1	AAA	1.68
300D	115955.SH	23 兴业 C1	AAA	1.68
300D	115955.SH	23 兴业 C1	AAA	1.68
310D	240151.SH	23 东证 C3	AAA	1.67
310D	240151.SH	23 东证 C3	AAA	1.67
317D	240175.SH	23 亦庄 K3	AAA	1.63
329D	134081.SZ	24 国证 07	AAA	1.69
335D	136849.SH	16 华能债	AAA	1.71
335D	149711.SZ	21 粤电 03	AAA	1.74
346D(休 2)	242017.SH	24 国君 C4	AAA	1.69
348D	240360.SH	23 信投 13	AAA	1.67
359D+2Y	133731.SZ	23 罗投控 01	AAA	1.84 行权
359D+2Y	133731.SZ	23 罗投控 01	AAA	1.84 行权
363D+2Y	253409.SH	23 抚州 06	AA+	1.90 行权
1.01Y(休 2)	253313.SH	23 左海 04	AAA	1.82
1.05Y(休 1)	240467.SH	24 青信 02	AAA	1.82
1.05Y+2Y	253589.SH	24 吴城 01	AA+	1.89 行权
1.06Y	253539.SH	24 扬子 01	AAA	1.83
1.06Y	253539.SH	24 扬子 01	AAA	1.83
1.07Y+1Y	032380076.IB	23 新开元 PPN001	AA	2.05 行权
1.08Y	240516.SH	24 国券 C1	AAA	1.7
1.08Y+2Y	240521.SH	24 舟城 01	AA+	1.84 行权
1.08Y+2Y	240521.SH	24 舟城 01	AA+	1.84 行权
1.1Y	240550.SH	24 宝武 K1	AAA	1.65
1.1Y(休 1)	253620.SH	24 吴江 01	AAA	1.86
1.1Y(休 1)	253620.SH	24 吴江 01	AAA	1.86
1.11Y	240568.SH	24 苏创 K1	AAA	1.77
1.11Y	240568.SH	24 苏创 K1	AAA	1.77
1.11Y+2Y	253648.SH	24 济能 01	AAA	1.89 行权
1.17Y	032480146.IB	24 青岛海控 PPN002	AAA	1.91
1.17Y	032480146.IB	24 青岛海控 PPN002	AAA	1.91
1.17Y	185430.SH	22 国惠 02	AAA	1.85
1.17Y	185430.SH	22 国惠 02	AAA	1.85
1.18Y+NY	240611.SH	建工 KY09	AAA	1.89 行权
1.2Y(休 2)	133773.SZ	24 滨控 K1	AA+	1.93

1.2Y(休 2)	133773.SZ	24 滨控 K1	AA+	1.93
1.21Y+2Y(休 1)	148634.SZ	24 中山投控 K2	AAA	1.73 行权
1.22Y+2Y	032480258.IB	24 海发国资 PPN002	AAA	1.92 行权
1.23Y	133783.SZ	24 康佳 03	AA	2.7
1.24Y	254265.SH	24 青城 05	AAA	1.87
1.33Y	148705.SZ	24 东莞 01	AAA	1.8
1.33Y	149887.SZ	22 润置 02	AAA	2.12
1.33Y	149887.SZ	22 润置 02	AAA	2.12
1.33Y	149887.SZ	22 润置 02	AAA	2.12
1.38Y	242603.SH	25 招证 K1	AAA	1.67
1.41Y	115128.SZ	24 国元 C1	AAA	1.87
1.59Y+2Y(休 2)	184505.SH	22 椒江 01	AA+	1.84 行权
1.59Y+2Y(休 2)	184505.SH	22 椒江 01	AA+	1.84 行权
1.64Y(休 2)	241440.SH	24 建材 K6	AAA	1.73
1.64Y(休 2)	241441.SH	24 国券 G1	AAA	1.76
1.65Y+2Y(休 1)	137698.SH	22 铁发 K2	AAA	1.74 行权
1.69Y	241545.SH	24 华电 K3	AAA	1.7
1.69Y	241545.SH	24 华电 K3	AAA	1.7
1.7Y(休 1)	137769.SH	22 银河 G5	AAA	1.75
1.74Y+5Y	137851.SH	G 诚通 K01	AAA	1.72 行权
1.75Y	243832.SH	25 浙商 K1	AAA	1.73
1.75Y	243832.SH	25 浙商 K1	AAA	1.73
1.82Y	243949.SH	25 开源 04	AAA	1.89
1.83Y(休 1)	240121.SH	23 恒信 G3	AAA	1.9
1.84Y+NY	137957.SH	22 中泰 Y1	AAA	1.97 行权
1.87Y	241885.SH	河钢 KV01	AAA	1.93
1.87Y(休 2)	2421017.IB	24 南海农商债	AAA	1.86
1.87Y+2Y	524515.SZ	25 桂交 03	AAA	1.89 行权
1.91Y(休 2)	241983.SH	24 豫港 07	AAA	2.04
1.94Y	138603.SH	22 常高 G1	AAA	1.95
1.94Y	138603.SH	22 常高 G1	AAA	1.95
1.96Y	242082.SH	24 河钢 K2	AAA	1.94
1.98Y	134722.SZ	25 国证 14	AAA	1.93
1.99Y+2Y	032481634.IB	24 聊城财信 PPN001	AA+	2.29 行权
2.08Y+21Y	242307.SH	25 京保 01	AAA	1.86 行权
2.16Y+NY	257548.SH	25 漳龙 Y2	AAA	2.25 行权
2.22Y+2Y	032501118.IB	25 宁乡国资 PPN001	AA	2.30 行权
2.27Y	2180095.IB	21 金牛环绿债 01	AA+	1.93
2.55Y	2522020.IB	25 奔驰汽车债 01	AAA	1.99
2.57Y	2522022.IB	25 国银金租债 02	AAA	1.92
2.62Y+NY	243401.SH	25 甬投 Y2	AAA	2.13 行权
2.65Y(休 2)	524404.SZ	25 申证 06	AAA	1.82
2.65Y(休 2)	524404.SZ	25 申证 06	AAA	1.82
2.65Y(休 2)	524404.SZ	25 申证 06	AAA	1.82
2.65Y(休 2)	524404.SZ	25 申证 06	AAA	1.82
2.66Y(休 1)	243590.SH	25 邮政 K2	AAA	1.76
2.66Y(休 1)	243590.SH	25 邮政 K2	AAA	1.76
2.67Y	243524.SH	25 北控 K3	AAA	1.75
2.68Y	115883.SH	23 渝高 03	AAA	1.9
2.74Y	115995.SH	23 中证 22	AAA	1.78
2.74Y	115995.SH	23 中证 22	AAA	1.78
2.81Y(休 1)	243902.SH	25 中泰 04	AAA	1.88
2.82Y+NY	240109.SH	23 华泰 Y2	AAA	2.05 行权
2.83Y	243976.SH	25 苏交 03	AAA	1.785
2.89Y+NY	240236.SH	铁工 YK18	AAA	1.99 行权

2.9Y(休 2)	244224.SH	25 润药 K3	AAA	1.78
2.9Y(休 2)	244224.SH	25 润药 K3	AAA	1.78
2.9Y(休 2)	244224.SH	25 润药 K3	AAA	1.79
2.9Y(休 2)	244224.SH	25 润药 K3	AAA	1.79
2.95Y	244332.SH	25 开源 K1	AAA	1.95
2.95Y	240361.SH	23 信投 14	AAA	1.78
2.98Y	244416.SH	25GTHTK5	AAA	1.79
2.98Y	244416.SH	25GTHTK5	AAA	1.79
2.98Y	244416.SH	25GTHTK5	AAA	1.79
2.98Y	244416.SH	25GTHTK5	AAA	1.79
2.98Y(休 1)	244423.SH	G25 苏能 1	AAA	2.12
2.98Y+2Y	524601.SZ	25 拱城控 02	AAA	1.94 行权
2.98Y+2Y	524601.SZ	25 拱城控 02	AAA	1.94 行权
3.22Y	148643.SZ	24 鲲鹏 02	AAA	1.92
3.48Y(休 2)	148777.SZ	24 招路 K1	AAA	1.86
3.48Y(休 2)	148779.SZ	24 穗开 K1	A+	1.89
3.49Y+5Y	272480002.IB	24 新华人寿资本补充债 01	AAA	2.14 行权
3.54Y(休 1)	241192.SH	24 光明 02	AAA	1.85
3.54Y	148809.SZ	24 粤环保 K1	AAA	1.9
3.66Y	255554.SH	24 盐控 02	AAA	2.42
3.75Y	255927.SH	24 仑港 02	AA	2.3
3.76Y	255949.SH	24 驻产 03	AA+	2.75
3.84Y	256152.SH	24 盐控 04	AAA	2.43
3.98Y+NY	242189.SH	24 国创 Y1	AAA	2.4 行权
3.98Y+NY	242189.SH	24 国创 Y1	AAA	2.4 行权
4.05Y	524101.SZ	25 赣水 K1	AAA	1.95
4.05Y	524101.SZ	25 赣水 K1	AAA	1.95
4.08Y	257350.SH	25 国创 F2	AAA	2.36
4.17Y(休 1)	032580131.IB	25 乌城投 PPN001A	AAA	2.33
4.24Y	257991.SH	25 南康 01	AA	2.8
4.41Y	524277.SZ	25 东财证券 03	AAA	2.14
4.62Y	259625.SH	25 恒业 06	AA+	3.05
4.86Y+5Y(休 2)	272580003.IB	25 中国人寿财险资本补充债 01	AAA	2.345 行权
4.86Y+5Y(休 2)	272580003.IB	25 中国人寿财险资本补充债 01	AAA	2.345 行权
4.89Y	244188.SH	建材 K16	AAA	1.955
4.89Y	244188.SH	建材 K16	AAA	1.955
4.9Y(休 1)	244213.SH	25HPI01K	AAA	1.915
4.94Y	280901.SH	25 钱新 01	AA+	2.38
4.98Y(休 1)	524589.SZ	25 深投 08	AAA	2.06
4.98Y(休 1)	524589.SZ	25 深投 08	AAA	2.06
4.98Y	244406.SH	25 甬交 K1	AAA	2.12
6.33Y	185712.SH	22 国君 G4	AAA	2.13
6.65Y	137675.SH	22 锡建 G1	A+	2.4
7.47Y	115509.SH	23 诚通 12	AAA	2.3
7.47Y	115509.SH	23 诚通 12	AAA	2.3
7.72Y	115969.SH	23 银河 G7	AAA	2.24
9.38Y(休 1)	242881.SH	25 诚通 05	AAA	2.46
9.38Y(休 1)	242881.SH	25 诚通 05	AAA	2.46
9.38Y(休 1)	242881.SH	25 诚通 05	AAA	2.46
9.54Y+NY	243325.SH	华能 YK16	AAA	2.51 行权
9.56Y	243344.SH	25 国丰 08	AAA	2.6

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评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。