

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

【2024-07-16】

国债

今日央行开展 6760 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 20 亿，全口径资金净投放 6740 亿。

国债方面 2.61Y 240003 1.775-1.78； 4.25Y 230022 1.948-1.96； 6.45Y 230028 2.0875-2.095； 9.37Y 230026 2.2575-2.27； 28.76Y 230009 2.483-2.5。

	1	3	5	7	10	30
昨日国债(%)	1. 5200	1. 7800	1.9600	2.1000	2.2601	2.4600
今日国债(%)	1. 5100	1.7800	1.9600	2.0930	2.2630	2.4650
变动(%)	-0. 0100	0. 0000	0.0000	-0.0070	0.0029	0.0050

金融债

金融债方面 298D 240411 1.72； 2.61Y 220203 1.91-1.915； 4.16Y 230415 2.035； 6.63Y 210205 2.16-2.1625； 9.16Y 230215 2.3175-2.3275。

	1	3	5	7	10
昨日非国开金融债(%)	1.7200	1. 9350	2.0575	2. 2400	2.3050
今日非国开金融债(%)	1. 7200	1.9325	2. 0550	2.2400	2. 3000
变动(%)	0.0000	-0.0025	-0.0025	0.0000	-0.0050
昨日国开债(%)	1. 7000	1.8950	2.0180	2.1500	2.3310
今日国开债(%)	1.7000	1. 9400	2.0150	2.1430	2.3300
变动(%)	0.0000	0.0450	-0.0030	-0.0070	-0.0010

短期融资券

今日银行间短融市场交投较为活跃，基成交主要集中于 Q3 期限。短端方面，37D 012481789.IB 24 华电租赁 SCP003 AAA 在 2.01%成交（估值位置）， 银行出给基金；66D 012482037.IB 24 伊利实业 SCP015 AAA 在 1.92%成交（估值+3 位置）， 银行出给基金；中长端方面，129D 012482094.IB 24 厦国贸 SCP008 AAA 在 2.00%成交（估值+2 位置）， 银行出给基金；177D 012481562.IB 24 津渤海 SCP007 AAA 在 2.12%成交（估值-3 位置）， 基金出给基金；长端方面，237D 012481814.IB 24 温州铁投 SCP004 AAA 在 2.02%成交（估值-2 位置）， 银行出给基金；318D 042480288.IB 24 湘高速 CP004 AAA 在 2.02%成交（估值-4 位置）， 银行出给券商；短端和中长端收益率均略微上行。

	评级	1M		3M		6M		9M		12M	
绝对收益率	AAA	1.91		1.95		1.98		1.99		2.02	
	AA+	2		2.01		2.08		2		2.1	
	AA	2.09		2.24		2.17		2.23		2.24	
	AA-	2.87		3.26		3.44		3.86		3.99	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA	1.92	-1	1.93	2	1.98	0	2	-1	2.03	-1
	AA+	2.01	-1	2.03	-2	2.09	-1	2.11	-11	2.12	-2
	AA	2.08	1	2.24	0	2.18	-1	2.23	0	2.24	0

	AA-	2.88	-1	3.27	-1	3.48	-4	3.85	1	4	-1
--	-----	------	----	------	----	------	----	------	---	---	----

中期票据

今日中票交投情绪较为平淡。1-3 年短端中票，20 苏轨交 MTN002（AAA，1.09Y）在 2.02%位置成交，高估值 1bp；24 南昌建投 MTN003（AAA，1.89Y）在 2.21%成交，低估值 3bp 成交；24 四川机场 MTN001(可持续挂钩）（AAA，2.5Y）在 2.12%成交，低估值 2bp 成交；3 到 5 年期限，24 湘高速 MTN008（AAA，4.96Y）在 2.30%低估值 1.5bp 位置成交；24 江西交投 MTN009（AAA，4.99）成交在 2.28%，高估值 1bp 成交。5Y 及以上期限，24 云能投 GN001（AAA，6.93Y）成交在 2.94%，高估值 4bp 位置成交；24 中电国际 GN002（AAA，9.93Y）成交在 2.53%，估值位置成交。总体而言，今日中票收益震荡，较前一日略有下行。

	评级	1y		3y		5y		7y		10y	
绝对收益率	AAA+	2		2.12		2.25		2.4		None	
	AAA	2.07		2.2		2.35		None		None	
	AA+	2.15		2.29		2.51		None		None	
	AA	2.23		2.34		2.8		None		None	
与昨日收益变动对照 (BP)	AAA+	1.97	3	2.11	1	2.24	1	2.39	1	None	None
	AAA	2.05	2	2.18	2	2.34	1	None	None	None	None
	AA+	2.13	2	2.27	2	2.49	2	None	None	None	None
	AA	2.2	3	2.33	1	2.79	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，中电 GK01 AAA 成交在 2.06%，基金卖出，银行理财买入。23 京保 03 AAA 成交在 2.15%。券商卖出，保险买入。24 穗城 04 AAA 成交在 2.255%。城投方面，19 海城投债 AA+ 成交在 2.15%，基金卖出，券商资管买入。13 同煤债 AAA 成交在 2.38%，保险卖出，券商买入。21 长发 05 AAA 成交在 2.20%。长端方面，24 赣投 K1 AAA 成交在 2.565%，券商资管卖出，券商资管买入。24 首钢 06 AAA 成交在 2.55%，券商卖出，券商资管买入。

银行债

今日银行二永及商金均成交相对平淡，二永主要集中在 5y 期限，其他期限成交寥寥， 成交区间基本在估值+/-1 位置。开盘 24 农行永续债 02 率先成交 2.305（-0.5）位置，随后随市场下行，于 2.3 位置成交，理财和资管出给基金。24 工行永续债 01 成交 2.3025（-1.5）位置，尾盘上行至 2.31 位置成交，券商和理财出给基金。24 广州农商永续债 01 全天成交在 2.41（估值）位置，资管和基金出给理财和资管。商金市场情绪一般，成交在估值附近位置，主要集中在股份制及城商行。2.99Y 24 中信银行债 01 成交 2.0825 和 2.09 位置，外资和理财出给基金和资管。1.05Y 22 中信银行 02 成交 1.97（估值）位置，基金出给大行。318D 22 广发银行 01 成交 1.95（+1）位置，基金出给基金和资管。193D 22 浦发银行 01 成交 1.95 位置。基金出给基金。

美元债

AMC 板块，信达今天定价双期限新发，带动板块交易，长城 GRWALL 7.15 PERP 上涨 0.1pt。城投板块，新发的青岛国信（维好）表现平平，市场在 99.675/99.875。好名字 2-3Y 买盘更为强劲，台州城建 TZCONS 5.45 27 上涨 0.5pt 至 100.25/100.5 附近。点心债方面，衡阳城投 HEURBA 4.86 27 较上周下行 5bp，荆州城发、保定国定等有买盘需求。房地产板块，整体仍旧比较安静。碧桂园、中骏、西部水泥等名字有看到少量买盘。

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
30D	042380455.IB	23 象屿金象 CP002	AAA/A-1	2.03%
37D	012481789.IB	24 华电租赁 SCP003	AAA	2.01%
43D	042380492.IB	23 高淳经开 CP009	AA	2.05%
48D	012480727.IB	24 国能资本 SCP001	AAA	1.9165%
48D	012480727.IB	24 国能资本 SCP001	AAA	1.9165%
59D	012384500.IB	23 昆明轨道 SCP002	AAA	2.23%
59D	012384500.IB	23 昆明轨道 SCP002	AAA	2.23%
65D	012481927.IB	24 昆山文商 SCP004	AA	2.03%
66D	012482037.IB	24 伊利实业 SCP015	AAA	1.92%
66D	012482037.IB	24 伊利实业 SCP015	AAA	1.92%

66D	012482037.IB	24 伊利实业 SCP015	AAA	1.92%
67D(休 2)	012480890.IB	24 广州地铁 SCP003	AAA	2.02%
73D	012482073.IB	24 伊利实业 SCP018	AAA	1.92%
73D	012482073.IB	24 伊利实业 SCP018	AAA	1.92%
73D	012482073.IB	24 伊利实业 SCP018	AAA	1.92%
97D	012480354.IB	24 鼎力投资 SCP001	AA	2.16%
107D	012482066.IB	24 苏交通 SCP015	AAA	1.91%
114D	012481745.IB	24 天成租赁 SCP005	AAA	2.00%
115D	012482133.IB	24 沪数据港 SCP002(科创票 据)	AA+	2.02%
115D	012482133.IB	24 沪数据港 SCP002(科创票 据)	AA+	2.02%
129D	012482094.IB	24 厦国贸 SCP008	AAA	2.00%
158D(休 2)	012481056.IB	24 宜兴城投 SCP002	AA+	2.09%
176D	042480012.IB	24 汤山建设 CP001	AA+	2.09%
176D	042480012.IB	24 汤山建设 CP001	AA+	2.09%
177D	012481562.IB	24 津渤海 SCP007	AAA	2.12%
184D	012482095.IB	24 华数 SCP003	AAA	2.02%
184D	012482095.IB	24 华数 SCP003	AAA	2.02%
210D	012482152.IB	24 华数 SCP004	AAA	2.03%
210D	012481599.IB	24 柳钢集团 SCP005(科创票 据)	AAA	2.10%
227D	012481749.IB	24 招金 SCP004	AAA	2.01%
237D	012481814.IB	24 温州铁投 SCP004	AAA	2.02%
237D	012481814.IB	24 温州铁投 SCP004	AAA	2.02%
241D	012481907.IB	24 融和融资 SCP005	AAA	2.03%
241D	012481907.IB	24 融和融资 SCP005	AAA	2.03%
241D	012481907.IB	24 融和融资 SCP005	AAA	2.03%
241D	012481907.IB	24 融和融资 SCP005	AAA	2.03%
241D	012481907.IB	24 融和融资 SCP005	AAA	2.03%
241D	012481907.IB	24 融和融资 SCP005	AAA	2.03%
242D(休 2)	012481869.IB	24 武清国资 SCP004	AA+	2.15%
252D	012482004.IB	24 立讯精工 SCP003	AA+	2.08%
255D	012482016.IB	24 柯桥开发 SCP002	AA+	2.07%
261D	042480195.IB	24 包钢集 CP002	AAA	2.18%
266D	012482129.IB	24 台州金融 SCP001	AA+	2.08%
266D	012482129.IB	24 台州金融 SCP001	AA+	2.08%
266D	012482129.IB	24 台州金融 SCP001	AA+	2.08%
270D(休 2)	042480208.IB	24 镇海投资 CP001	AA+	2.05%
318D	042480288.IB	24 湘高速 CP004	AAA	2.02%
318D	042480288.IB	24 湘高速 CP004	AAA	2.02%
318D	042480288.IB	24 湘高速 CP004	AAA	2.02%
318D	042480288.IB	24 湘高速 CP004	AAA	2.02%

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
9D	101900993.IB	19 国新控股 MTN003	AAA	1.96%
9D	101900993.IB	19 国新控股 MTN003	AAA	1.96%

23D+3Y(休 1)	102281724.IB	22 华发实业 MTN002B	AAA	100.2
148D+2Y	102383296.IB	23 华发实业 MTN005	AAA	1.94%
153D	101901679.IB	19 汉江国资 MTN002	AAA	1.98%
178D	102280046.IB	22 南通产业 MTN001	AA+	2.05%
209D+NY	102380165.IB	23 中冶 MTN001	AAA	2.07%
222D+2Y	102280335.IB	22 滁州城投 MTN003	AA+	2.06%
222D+2Y	102280335.IB	22 滁州城投 MTN003	AA+	2.06%
247D+NY	102380594.IB	23 中电投 MTN005(能源保供特别债)	AAA	2.03%
256D+2Y	102280664.IB	22 石交投 MTN003	AA	2.07%
271D(休 1)	102380884.IB	23 六合国资 MTN001	AA+	2.11%
272D	102000666.IB	20 大横琴 MTN001	AAA	2.10%
274D	102000484.IB	20 乌高新 MTN001	AA+	2.08%
278D(休 1)	102280836.IB	22 赣金控 MTN002	AAA	2.08%
284D+3Y	102381050.IB	23 大足发展 MTN001	AA+	2.21%
284D+3Y	102381050.IB	23 大足发展 MTN001	AA+	2.21%
296D	102000941.IB	20 淮南建发 MTN001	AA+/AA	2.12%
318D	102281158.IB	22 越秀集团 MTN001	AAA	2.08%
1.03Y+1Y(休 1)	102300408.IB	23 娄底城控 MTN002	AA+	2.20%
1.03Y+1Y(休 1)	102300408.IB	23 娄底城控 MTN002	AA+	2.20%
1.07Y	102200197.IB	22 宜春交通 MTN003	AA+	2.07%
1.07Y	102200195.IB	22 荆门高新 MTN002	AA	2.16%
1.09Y	102001566.IB	20 苏轨交 MTN002	AAA	2.02%
1.26Y	102001925.IB	20 九龙江 MTN004	AAA	2.11%
1.28Y+2Y	102282388.IB	22 襄阳高新 MTN001	AA	2.15%
1.32Y(休 1)	102383020.IB	23 晋能煤业 MTN009	AAA	2.08%
1.32Y(休 1)	102383020.IB	23 晋能煤业 MTN009	AAA	2.08%
1.59Y(休 6)	102380224.IB	23 连云港 MTN001	AA+	2.35%
1.85Y+NY(休 1)	102381219.IB	23 中电投 MTN017	AAA	2.10%
1.87Y(休 2)	102482096.IB	24 贵州高速 MTN002	AAA	2.18%
1.87Y(休 2)	102482096.IB	24 贵州高速 MTN002	AAA	2.18%
1.88Y	102381282.IB	23 亳州城建 MTN001	AA	2.29%
1.89Y+NY	102482164.IB	24 南昌建投 MTN003	AAA	2.21%
1.89Y+NY	102482164.IB	24 南昌建投 MTN003	AAA	2.21%
1.92Y	102101118.IB	21 青岛地铁 MTN002(碳中和债)	AAA	2.12%
1.96Y+2Y	102381567.IB	23 长寿投资 MTN003	AA+	2.36%
2.12Y	102101714.IB	21 大横琴 MTN001	AAA	2.25%
2.28Y	102382892.IB	23 临沂城投 MTN002	AAA	2.18%
2.28Y	102382892.IB	23 临沂城投 MTN002	AAA	2.18%
2.56Y+2Y	102480462.IB	24 京城投 MTN002	AAA	2.30%
2.78Y	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA	2.10%
2.78Y	102481828.IB	24 汇金 MTN002	AAA	2.10%
2.85Y	102482044.IB	24 邮政 MTN002	AAA	2.12%
2.87Y(休 2)	102482090.IB	24 山东港口 MTN003	AAA	2.1616%
2.87Y+2Y	102400778.IB	24 光谷金控 MTN001(科创票据)	AAA	2.26%
2.92Y	102281294.IB	22 保利发展 MTN003B	AAA	2.31%

2.92Y	102281294.IB	22 保利发展 MTN003B	AAA	2.31%
2.95Y	102482801.IB	24 越秀集团 MTN005A	AAA	2.19%
2.98Y+NY	102482893.IB	24 湘高速 MTN009	AAA	2.22%
2.98Y+NY	102482893.IB	24 湘高速 MTN009	AAA	2.22%
2.98Y	102482905.IB	24 甘国投 MTN004	AAA	100.05
2.99Y(休 1)	102482972.IB	24 苏交通 MTN009	AAA	2.13%
2.99Y(休 1)	102482947.IB	24 华电股 MTN003	AAA	2.115%
2.99Y(休 1)	102482947.IB	24 华电股 MTN003	AAA	2.115%
2.99Y(休 1)	102482972.IB	24 苏交通 MTN009	AAA	2.13%
4.96Y	102482833.IB	24 湘高速 MTN008	AAA	2.30%
4.97Y	102482862.IB	24 金华交通 MTN001	AA+	100
4.99Y	102482908.IB	24 江西交投 MTN009	AAA	2.28%
4.99Y	102482908.IB	24 江西交投 MTN009	AAA	2.28%
4.99Y	102482908.IB	24 江西交投 MTN009	AAA	2.27%
4.99Y	102482908.IB	24 江西交投 MTN009	AAA	2.26%
4.99Y	102482908.IB	24 江西交投 MTN009	AAA	2.26%
4.99Y	102482908.IB	24 江西交投 MTN009	AAA	2.26%
5Y(休 1)	102483008.IB	24 西宁城投 MTN003	AA+	3.40%
6.93Y	132480055.IB	24 云能投 GN001	AAA	2.94%
7.75Y	102280767.IB	22 闽高速 MTN004	AAA	2.375%
9.74Y	102481434.IB	24 无锡城建 MTN001	AAA	2.57%
9.91Y	102482272.IB	24 金圆投资 MTN001	AAA	2.62%
9.93Y	132480053.IB	24 中电国际 GN002	AAA	2.53%
9.93Y	132480053.IB	24 中电国际 GN002	AAA	2.53%
9.94Y(休 2)	102482686.IB	24 晋能装备 MTN003	AAA	2.71%
9.94Y(休 2)	102482686.IB	24 晋能装备 MTN003	AAA	2.71%
9.95Y	102482755.IB	24 国新控股 MTN002	AAA	2.52%
9.95Y	102482755.IB	24 国新控股 MTN002	AAA	2.52%
9.95Y	102482755.IB	24 国新控股 MTN002	AAA	2.52%
9.95Y	102482755.IB	24 国新控股 MTN002	AAA	2.52%
9.97Y	102482865.IB	24 豫交投 MTN006	AAA	2.56%
9.98Y	102482923.IB	24 深圳地铁 MTN003A	AAA	2.53%

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
13D	188458.SH	21 海通 06	AAA	1.90%
13D	155560.SH	19 宏泰 02	AAA	2.01%
28D	151971.SH	PR 天门 02	AA	2.60%
35D	155618.SH	19 东航 01	AAA	2.00%
35D	155618.SH	19 东航 01	AAA	2.00%
37D	252156.SH	23 濮阳 D1	AA	2.32%
64D+1.99Y	196950.SH	21 即墨 03	AA+	2.26%
70D	162203.SH	19 即墨 01	AA/AA+	2.32%
76D+1.99Y	197271.SH	21 盐控 03	AAA	2.08%
91D	2122055.IB	21 招联消费金融债 05	AAA	1.90%
91D	2122055.IB	21 招联消费金融债 05	AAA	1.90%
95D(休 2)	188871.SH	21 平证 11	AAA	1.89%

136D	162630.SH	19 甬象 02	AA	2.15%
154D+1Y	177371.SH	20 延安 03	AA+	2.23%
222D+NY(休 1)	185412.SH	22 大唐 Y3	AAA	2.03%
241D+2Y(休 1)	194011.SH	22 融控 01	AAA	2.14%
250D+NY(休 1)	163933.SH	20 华能 Y2	AAA	2.04%
288D	163521.SH	20 北汽 03	AAA	2.10%
294D	2280223.IB	22 沪地产 02	AAA	2.05%
355D(休 1)	185973.SH	22 国君 G7	AAA	1.97%
1.02Y+2Y	137536.SH	22 中化 T1	AAA	2.10%
1.03Y+2Y	194948.SH	GC 临投 03	AA+	2.20%
1.07Y+2Y	137633.SH	22 湘新 01	AAA	2.03%
1.17Y+1Y	252397.SH	23 周投 03	AA+	2.13%
1.18Y	182715.SH	22 太港 02	AA	2.17%
1.2Y+NY	148076.SZ	22 华润 Y2	AAA	2.07%
1.27Y	240112.SH	23BEHL02	AAA	2.06%
1.27Y	240112.SH	23BEHL02	AAA	2.06%
1.27Y	240112.SH	23BEHL02	AAA	2.06%
1.49Y	184686.SH	23 京投 01	AAA	2.05%
1.51Y(休 1)	185268.SH	22 安租 02	AAA	2.21%
1.56Y	138862.SH	中电 GK01	AAA	2.06%
1.56Y(休 2)	148179.SZ	23 国证 02	AAA	2.00%
1.56Y(休 2)	148179.SZ	23 国证 02	AAA	2.00%
1.59Y(休 1)	114900.SH	23 太湖 01	AA+	2.13%
1.59Y	148184.SZ	23 长江 02	AAA	2.05%
1.67Y	175873.SH	21 星发 01	AA+	2.14%
1.71Y	1980103.IB	19 海城投债	AA+/AAA	2.15%
1.78Y	178530.SH	21 锦国 01	AA+	3.30%
1.9Y	149504.SZ	21 新兴 01	AAA	2.12%
1.91Y+NY(休 1)	115512.SH	葛洲 YK05	AAA	2.12%
1.92Y	149516.SZ	21 建能 01	AAA	2.08%
2.02Y+NY	115711.SH	华能 YK06	AAA	2.12%
2.03Y(休 1)	149573.SZ	21DJLQ03	AAA	2.13%
2.03Y(休 1)	149573.SZ	21DJLQ03	AAA	2.13%
2.07Y+2Y	149588.SZ	21 中海 06	AAA	2.27%
2.07Y+2Y	149588.SZ	21 中海 06	AAA	2.27%
2.07Y	188568.SH	21 招证 10	AAA	2.03%
2.12Y	152258.SH	19 陕投 02	AAA	2.14%
2.12Y	252166.SH	23 山交 02	AAA	2.19%
2.13Y+NY	115895.SH	23 太新 Y4	AAA	2.21%
2.26Y	115955.SH	23 兴业 C1	AAA	2.12%
2.43Y+21Y	240427.SH	23 京保 03	AAA	2.15%
2.76Y	148704.SZ	24 东北 01	AAA	2.15%
2.88Y+2Y	185827.SH	22 保利 04	AAA	2.30%
3.08Y(休 2)	2080208.IB	20 黄冈停车债	AA+	2.25%
3.77Y	124285.SH	13 同煤债	AAA	2.38%
4.08Y	152993.SH	21 长发 05	AAA	2.20%
4.81Y(休 1)	254648.SH	24 城发 04	AA+	3.00%

4.9Y	254993.SH	24 洛晟 03	AAA	2.69%
4.99Y(休 2)	194932.SH	22 锡城 02	AAA	2.32%
6.93Y	255052.SH	24 发投 03	AAA	2.57%
9.52Y(休 1)	271073.SH	G24 厦轨 1	AAA	2.54%
9.93Y	241153.SH	24 赣投 K1	AAA	2.565%
9.93Y	241153.SH	24 赣投 K1	AAA	2.57%
9.98Y(休 1)	241209.SH	24 首钢 06	AAA	2.55%
10Y(休 1)	241293.SH	24 杭资 K1	AAA	2.58%
14D	032100810.IB	21 徐州盛铜 PPN001	AA	2.15%
20D+2Y	032100818.IB	21 江宁经开 PPN003	AAA	2.18%
72D	032101075.IB	21 吴中城投 PPN006	AA+	2.05%
184D+3Y(休 1)	032380070.IB	23 邵阳城投 PPN001	AA	2.20%
240D+3Y	032380203.IB	23 上饶国资 PPN001B	AA+	2.16%
296D	032380448.IB	23 金水投资 PPN001	AA+	2.15%
360D	032400820.IB	24 京开投 PPN005	AA	2.60%
1.09Y+3Y	032380766.IB	23 德州财金 PPN002	AA+	2.20%
1.32Y	032300534.IB	23 悦达 PPN002	AAA	2.27%
1.32Y	032300534.IB	23 悦达 PPN002	AAA	2.27%
1.41Y	032480482.IB	24 昆明安居 PPN003	AA+	2.95%
1.76Y+2Y	032380382.IB	23 常德城投 PPN006	AA+	2.18%
1.9Y	032380528.IB	23 临平开投 PPN003	AA+	2.17%
2.05Y+2Y	032380725.IB	23 西盛投资 PPN004	AA+	2.26%
2.77Y(休 2)	032480423.IB	24 泰兴城投 PPN007	AA+	2.28%
2.87Y(休 1)	032480487.IB	24 南宁高新 PPN001	AA	2.86%
4.87Y	032400760.IB	24 洛阳国晟 PPN001	AAA	2.69%
4.97Y	032400817.IB	24 丽水文旅 PPN001	AA	2.45%
14D+NY	1928018.IB	19 工商银行永续债	AAA	1.95%
65D+5Y	1928026.IB	19 兴业银行二级 02	AAA	1.94%
66D+NY	1928025.IB	19 交通银行永续债	AAA	1.96%
66D+NY	1928025.IB	19 交通银行永续债	AAA	1.96%
66D+NY	1928025.IB	19 交通银行永续债	AAA	1.95%
66D+NY	1928025.IB	19 交通银行永续债	AAA	1.95%
73D+NY	1928031.IB	19 广发银行永续债	AAA	1.96%
193D(休 2)	2228007.IB	22 浦发银行 01	AAA	1.95%
318D	2228033.IB	22 广发银行 01	AAA	1.95%
1.05Y+5Y(休 2)	2028025.IB	20 浦发银行二级 01	AAA	2.00%
1.05Y	2228046.IB	22 中信银行 02	AAA	1.97%
1.05Y	2228046.IB	22 中信银行 02	AAA	1.97%
1.16Y+5Y(休 2)	2028033.IB	20 建设银行二级	AAA	2.00%
1.18Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.005%
1.18Y+5Y(休 2)	2028038.IB	20 中国银行二级 01	AAA	2.005%
1.19Y+NY	2028040.IB	20 交通银行永续债	AAA	2.01%
1.41Y+NY(休 1)	2028053.IB	20 中国银行永续债 03	AAA	2.02%
1.74Y	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	2.00%
2.03Y	2320033.IB	23 厦门银行小微债 01	AAA	2.05%
2.07Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.06%
2.07Y+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	2.06%

2.12Y+NY	2120075.IB	21 台州银行永续债 02	AAA/AA+	2.18%
2.16Y+5Y(休 2)	2121039.IB	21 成都农商二级 01	AAA/AA+	2.165%
2.16Y+5Y(休 2)	2121039.IB	21 成都农商二级 01	AAA/AA+	2.165%
2.16Y+5Y(休 2)	2121039.IB	21 成都农商二级 01	AAA/AA+	2.165%
2.32Y+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	2.07%
2.32Y+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	2.07%
2.32Y+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	2.075%
2.39Y(休 2)	292380009.IB	23 德银股份债 02	AAA	2.19%
2.76Y	292480004.IB	24 法农银行债 01BC	AAA	2.205%
2.94Y	2421005.IB	24 珠海农商	AA+	2.18%
2.97Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.10%
2.97Y(休 1)	2420030.IB	24 南京银行 02	AAA	2.10%
2.99Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	2.09%
2.99Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	2.08%
2.99Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	2.0825%
3.13Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	2.16%
3.13Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	2.16%
3.14Y+NY(休 1)	092280086.IB	22 农行永续债 02	AAA	2.1625%
3.14Y+NY(休 1)	092280086.IB	22 农行永续债 02	AAA	2.17%
3.32Y+5Y	092280134.IB	22 工行二级资本债 04A	AAA	2.135%
4.01Y+NY	242380013.IB	23 建行永续债 01	AAA	2.2475%
4.11Y+5Y	232380032.IB	23 华兴银行二级资本债 01	AA+/AA	3.23%
4.34Y+5Y	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	AAA	2.225%
4.56Y+5Y	232480004.IB	24 农行二级资本债 01A	AAA	2.24%
4.66Y+NY	242400005.IB	24 农行永续债 01	AAA	2.285%
4.67Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.29%
4.67Y+NY(休 1)	242400004.IB	24 邮储永续债 01	AAA	2.295%
4.73Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	2.24%
4.77Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.31%
4.78Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.24%
4.78Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.24%
4.78Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.2425%
4.78Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.2325%
4.78Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.24%
4.78Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.24%
4.78Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.24%
4.78Y+5Y	232480011.IB	24 农行二级资本债 02A	AAA	2.24%
4.78Y+5Y	1928012.IB	19 工商银行二级 04	AAA	2.24%
4.78Y+5Y	1928012.IB	19 工商银行二级 04	AAA	2.2325%
4.78Y+5Y	1928012.IB	19 工商银行二级 04	AAA	2.2325%
4.79Y+5Y(休 2)	232480014.IB	24 交行二级资本债 01A	AAA	2.24%
4.79Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.42%
4.84Y+1Y	312400002.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.21%
4.85Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.285%
4.87Y+NY	242480003.IB	24 广州农商行永续债 01	AAA/AA+	2.41%
4.87Y+NY	242480003.IB	24 广州农商行永续债 01	AAA/AA+	2.41%
4.88Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.345%

4.89Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.305%
4.89Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.30%
4.89Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.30%
4.89Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.30%
4.89Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.30%
4.89Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.305%
4.92Y+5Y(休 2)	232400022.IB	24 成都银行二级资本债 01	AAA	2.35%
4.98Y+5Y(休 1)	232400025.IB	24 恒丰银行二级资本债 02	AAA	2.37%
4.98Y+5Y(休 1)	232400025.IB	24 恒丰银行二级资本债 02	AAA	2.37%
4.99Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.315%
4.99Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.315%
4.99Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.32%
4.99Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.31%
4.99Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.31%
4.99Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.31%
4.99Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.31%
4.99Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.3025%
4.99Y+NY	242480007.IB	24 工行永续债 01	AAA	2.3025%
9.99Y+5Y	232480036.IB	24 平安银行二级资本债 01B	AAA	2.4725%