



【2025-12-25】

国债

今日央行开展 1771 亿 7 天期逆回购操作，逆回购到期 883 亿，逆回购口径资金净投放 888 亿。

国债方面 21D 250001 1.18-1.18； 2.17Y 250005 1.315-1.315； 4.08Y 250003 1.52-1.5325； 6.25Y 250007 1.66-1.6625； 9.67Y 250016 1.832-1.841； 29.67Y 2500006 2.215-2.232。

	1y	3y	5y	7y	10y	30y
昨日国债(%)	1.3350	1.3500	1.5825	1.6940	1.8375	2.2200
今日国债(%)	1.3050	1.3420	1.5850	1.6995	1.8390	2.2260
变动(%)	-0.0300	-0.0080	0.0025	0.0055	0.0015	0.0060

金融债

金融债方面 19D 250301 1.32-1.33； 3.16Y 240203 1.67-1.675； 6.06Y 220205 1.85-1.8525； 9.48Y 250215 1.8945-1.91。

	1 y	3y	5y	7y	10y
昨日非国开金融债(%)	1.5300	1.6350	1.7250	1.9350	1.9780
今日非国开金融债(%)	1.5225	1.6400	1.7300	1.9325	1.9830
变动(%)	-0.0075	0.0050	0.0050	-0.0025	0.0050
昨日国开债(%)	1.5000	1.6925	1.7100	1.9000	1.8990
今日国开债(%)	1.4850	1.6900	1.7125	1.8975	1.9060
变动(%)	-0.0150	-0.0025	0.0025	-0.0025	0.0070

银行债

5y 大行二级今日收益率区间内大幅度震荡。非免税券前收 2.205（+0.69），今开 2.205（+0.69）。日内最高 2.215（+1.69），最低 2.205（+0.69），震荡区间 1bp，今收 2.215(+1.69),尾盘对峙为 2.215/2.2075。盘中与同期限大行永续相差约 3bp,券商基金为主要参与方；

五年 25 工行二级资本债 02BC 前收 2.125（+0.46）,今开 2.1225(+0.21),日内最高 2.13(+0.96), 最低 2.1225(+0.21）, 今收 2.13(+0.96),尾盘对峙为 2.13/2.1275,市场成交依旧火热;

十年 25 农行二级资本债 03B(BC)昨收 2.53,今开 2.5325(+0.25),最高 2.5325(+0.25), 最低 2.5325(+0.25),今收 2.5325(+0.25),尾盘对峙为 2.535/2.53;

5y 股份制二永收益率震荡。4.42 招行永续成交在 2.235（-0.71）到 2.24（-0.21），震荡区间 0.5bp，昨日收在 2.245。今日股份制二永成交情绪一般，基金，保险有参与。

1-3y 大行二级今日成交收益率震荡；1y 大行今开 1.77/1.765，成交在 1.765（+0.19），尾盘收在 1.765/1.76。2y 大行今开 1.865/1.86，成交在 1.86（-0.66）和 1.865（-0.16），尾盘收在 1.86/1.855。今日 1-3y 大行二级交易情绪活跃，买盘力量较强，基金、银行以及保险为主要参与机构。

商金方面，1-3y 大行主要成在（-1.5）到（+0.5）。1.85y 24 交行债 03BC 成在 1.735（+0.27）。股份制主要成在（-1.5）到（+1.5）。1.55y 24 中信银行债 01 在 1.72（-0.01）。大城商行今日主要成在（-2）到（+0.5）。3y 25 江苏银行债 04BC 成在 1.8575（+0.13）到 1.86（+0.38）。科创今日主要成在（-1.5）到（+1.5）。收益率持续走高。银行、基金/ 基金、资管、银行为主。

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 2026Q1 期限。短端方面，29D 012582898.IB 25 龙源电力 SCP010 AAA 成交在 1.70%（+2.15），基金出给券商；41D 012581891.IB 25 皖交控 SCP008 AAA 成交在 1.69%（+2.0），银行出给基金。中长端方面，113D 012582283.IB 25 华电租赁 SCP009 AAA 成交在 1.76%（+0.7），银行出给基金；162D 012582981.IB 25 巨石 SCP010(科创债) AAA 成交在 1.70%（-0.9），银行出给基金。长端方面，232D 012582820.IB 25 湖南钢铁 SCP007 AAA 成交在 1.73%（+0.1），银行出给基金；235D 012582823.IB 25 日照能源 SCP001 AAA 成交在 1.87%，基金出给银行。总体而言，短端、中长端和长端收益日内震荡上行。

中期票据

今日中票收益早盘在估值-1 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%（-0.03）成交。汇金电网价差 0.5bp，10Y 电网今日成交在 2.365%（-0.69）。

1-3Y，好名字整体成交在估值-2 到估值+1，1.21Y 24 中电投 MTN001 成在 1.75%（+1.56），2.32Y 25 华电股 MTN005 成在 1.81%（-2.87），2.48Y 25 京国资 MTN006 成在 1.85%（+0.11）。成交收益率集中在 1.75%-2.00%，基金/银行为主。

3-5Y，好名字整体成交在估值-2 到估值+2，3.83Y 24 南航股 MTN012 成在 2.01%（-0.63），4.81Y 25 光大集团 MTN007A 成在 2.00%（-2.25），4.97Y 25 南昌轨交 MTN003 成在 2.13%（+0.06），收益率集中在 2.00%-2.20%，基金/资管为主。

5Y+，9.42Y 25 苏国信 MTN003 成在 2.42%（-0.05）；9.90Y 25 国新控股 MTN002(稳增长扩投资专项债) 成在 2.44%（-0.37），成交收益率主要集中在 2.35%-2.70%附近，银行、保险/ 券商为主。

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-1/+1，基金/理财为主。

企业债

交易所信用债全天交投较为活跃，基金，券商，保险，理财均有参与，基金保险为主。全天收益震荡，科创下行趋势减缓。

1 年内，券商债成交在估值附近（334D 23 招证 11 1.66），基金理财买，基金券商卖；非券商债多成交在 1.67-1.78，（334D 16 华能债 1.76），基金保险买，基金券商卖；年内科创债今日成交活跃（354D 23 招路 K2 1.60），基金买，基金保险卖。

1-3 年，今日券商债成交较为活跃，在估值-3 到估值（2.97Y 25GTHTK5 1.79），基金理财买，基金保险卖；非券商债多成交在 1.75-1.95，（1.82Y 22 沪城 01 1.81），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（2.5Y(休 2) 25 京投 K1 1.73），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 到估值+1.5（3.56Y 24 中化 09 1.90），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（4.48Y 25 铁工 K2 1.90），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；非券商债成交较活跃，成交多在估值-1 附近，（8.2Y 24 中化 02 2.63）基金，券商资管和保险资管双边参与买卖盘；科创方面亦成交较活跃，成交亦多在估值-1 附近，（6.41Y 22 国投 K2 2.12）基金双边参与买卖盘，券商亦有少量卖出。

美元债

周四海外正处在圣诞节假期中，年末机构调仓意愿较低，市场交投清淡。

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（%）
5D	012582691.IB	25 伊利实业 SCP017	AAA	1.735
29D	012582898.IB	25 龙源电力 SCP010	AAA	1.7
41D	012581891.IB	25 皖交控 SCP008	AAA	1.69
41D	012581891.IB	25 皖交控 SCP008	AAA	1.69
77D	072510102.IB	25 开源证券 CP003	AAA	1.635
91D	012583151.IB	25 厦国贸 SCP010	AAA	100.00 净价
91D	012583151.IB	25 厦国贸 SCP010	AAA	100.00 净价
91D	012583151.IB	25 厦国贸 SCP010	AAA	100.00 净价
91D	012583151.IB	25 厦国贸 SCP010	AAA	100.00 净价
113D	012582283.IB	25 华电租赁 SCP009	AAA	1.76
113D	012583149.IB	25 苏州高新 SCP030	A	100.00 净价
113D	012583149.IB	25 苏州高新 SCP030	A	100.00 净价
162D	012582981.IB	25 巨石 SCP010(科创债)	AAA	1.7
232D	012582820.IB	25 湖南钢铁 SCP007	AAA	1.73
235D	012582823.IB	25 日照能源 SCP001	AA+	1.87

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（%）
11D	102380001.IB	23 泉州城建 MTN001A	AAA	1.8
11D	102380004.IB	23 闽漳龙 MTN001	AAA	1.8
11D	102380004.IB	23 闽漳龙 MTN001	AAA	1.8
11D	102380004.IB	23 闽漳龙 MTN001	AAA	1.8
11D	102380004.IB	23 闽漳龙 MTN001	AAA	1.8
11D	102380004.IB	23 闽漳龙 MTN001	AAA	1.8
89D	102100538.IB	21 湘江新发 MTN001	AAA	1.71
89D	102100538.IB	21 湘江新发 MTN001	AAA	1.71
92D+NY	102481194.IB	24 温州交通 MTN001	AA+	1.85 行权
110D+NY	102380859.IB	23 中节能 MTN002B	AAA	1.81 行权
110D+NY	102380883.IB	23 甬开投 MTN001	AAA	1.81 行权
112D	102484418.IB	24 云能投 MTN024	AAA	1.78
172D+363D(休 1)	102482242.IB	24 鲁商 MTN003	BBB+	2.24 行权
174D	102101104.IB	21 衡阳城投 MTN001	AA+	1.77
178D(休 1)	102381495.IB	23 柯桥开发 MTN001	AAA	1.8
178D(休 1)	102381495.IB	23 柯桥开发 MTN001	AAA	1.8

178D(休 1)	102482384.IB	24 拜耳 MTN001BC	AAA	1.78
207D+NY(休 1)	102381724.IB	23 鲁高速 MTN007	AAA	1.83 行权
244D	102485350.IB	24 云工投 MTN001	AA+	2.21
253D+NY	102382348.IB	23 中冶 MTN012	AAA	1.82 行权
264D+NY	102382483.IB	23 中铁建 MTN001	AAA	1.81 行权
306D+2Y	102382919.IB	23 星城发展 MTN002	AA+	1.80 行权
334D	102300550.IB	23 顺德投资 MTN002		1.82
1.03Y	102480019.IB	24 南通高新 MTN001	AA+	1.81
1.05Y	102580177.IB	25 中铁置业 MTN001	AAA	2.02
1.05Y	102280091.IB	22 中海企业 MTN001B	AAA	2.02
1.05Y	102280091.IB	22 中海企业 MTN001B	AAA	2.02
1.05Y	102280091.IB	22 中海企业 MTN001B	AAA	2.02
1.11Y+2Y	102480425.IB	24 长沙经开 MTN001	AA+	1.84 行权
1.11Y+2Y	102480425.IB	24 长沙经开 MTN001	AA+	1.84 行权
1.21Y(休 2)	102480871.IB	24 中电投 MTN001	AAA	1.75
1.24Y(休 1)	102481027.IB	24 津地铁 MTN003A	AAA	1.91
1.24Y(休 1)	102481046.IB	24 赣国资 MTN002	AAA	1.79
1.24Y(休 1)	102481046.IB	24 赣国资 MTN002	AAA	1.79
1.26Y+2Y	102481292.IB	24 济源投资 MTN001	AA+	2.01 行权
1.26Y	102481303.IB	24 景德镇陶 MTN002	AA+	1.98
1.26Y	102481303.IB	24 景德镇陶 MTN002	AA+	1.98
1.29Y(休 1)	102280742.IB	22 川发展 MTN001	AAA	1.77
1.3Y	102280784.IB	22 华润 MTN003	AAA	1.75
1.31Y(休 2)	102481536.IB	24 昌吉州 MTN001	AA+	1.87
1.31Y(休 2)	102481536.IB	24 昌吉州 MTN001	AA+	1.87
1.31Y(休 2)	102481537.IB	24 苏州交投 MTN001(乡村振兴)	AAA	1.81
1.37Y	102281074.IB	22 豫投资 MTN001	AAA	1.83
1.45Y	102482203.IB	24 越秀集团 MTN004A	AAA	1.81
1.48Y	102482321.IB	24 镇江产投 MTN003	AAA	1.91
1.48Y(休 1)	102482397.IB	24 胶州城投 MTN002	AA+	2.05
1.48Y(休 1)	102482397.IB	24 胶州城投 MTN002	AA+	2.05
1.48Y(休 1)	102482397.IB	24 胶州城投 MTN002	AA+	2.05
1.48Y(休 1)	102482397.IB	24 胶州城投 MTN002	AA+	2.05
1.5Y+2Y	102482774.IB	24 合川投资 MTN002	AA	2.15 行权
1.56Y(休 1)	102501484.IB	25 长寿投资 MTN003	AA+	2.08
1.6Y	102483314.IB	24 相城城建 MTN005	AA+	1.88
1.7Y	102282050.IB	22 国新控股 MTN002(能源保供特别债)	AAA	1.8
1.74Y	102484189.IB	24 国航 MTN002	AAA	1.82
1.75Y+2Y(休 2)	102484191.IB	24 乌交旅 MTN004	AA+	1.95 行权
1.75Y	102584026.IB	25 海尔金盈 MTN005	AAA	2.1
1.8Y	102484389.IB	24 国能新能 MTN004	AAA	1.82
1.8Y	102282242.IB	22 衡阳城投 MTN004	AA+	2
1.8Y	102584199.IB	25 汇金 MTN006	AAA	1.79
1.8Y	102584199.IB	25 汇金 MTN006	AAA	1.79
1.83Y(休 1)	102484549.IB	24 晋中公用 MTN002	AA+	1.98
1.89Y(休 1)	102484927.IB	24 中电投 MTN025	AAA	1.8
1.93Y	102485208.IB	24 皖投集 MTN005	AAA	1.86
1.93Y	102485208.IB	24 皖投集 MTN005	AAA	1.86
1.94Y+2Y	102485243.IB	24 海通恒信 MTN004	AAA	1.90 行权
1.96Y	102485337.IB	24 晋能煤业 MTN015(科创票据)	AAA	1.94
1.98Y	102485443.IB	24 中石化 MTN004	AAA	1.8
1.98Y	102485443.IB	24 中石化 MTN004	AAA	1.8
1.98Y	102485443.IB	24 中石化 MTN004	AAA	1.8

1.98Y	102485443.IB	24 中石化 MTN004	AAA	1.8
1.99Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.81
1.99Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.81
1.99Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.81
1.99Y	102585306.IB	25 汇金 MTN008	AAA	1.81
1.99Y	102485521.IB	24 华电股 MTN009	AAA	1.82
2.07Y+NY	102580370.IB	25 大唐集 MTN001	AAA	1.96 行权
2.17Y(休 1)	102580836.IB	25 宿州城投 MTN002	AA+	2.01
2.21Y(休 2)	102480810.IB	24 津城建 MTN011	AAA	2.08
2.21Y(休 2)	102480810.IB	24 津城建 MTN011	AAA	2.08
2.25Y+2Y	102501261.IB	25 陕西水发 MTN001	AAA	2.02 行权
2.3Y+NY	102501304.IB	25 大唐集 MTN008	AAA	1.98 行权
2.3Y+NY	102501304.IB	25 大唐集 MTN008	AAA	1.98 行权
2.35Y(休 4)	102581980.IB	25 镇江文旅 MTN001	AA+	2.11
2.37Y	1382212.IB	13 鄂交投 MTN1	AAA	1.86
2.45Y	102582267.IB	25 汇金 MTN004	AAA	1.84
2.45Y	102582267.IB	25 汇金 MTN004	AAA	1.84
2.46Y	102582279.IB	25 义乌国资 MTN003	AAA	1.9
2.46Y	102582279.IB	25 义乌国资 MTN003	AAA	1.9
2.46Y	102582279.IB	25 义乌国资 MTN003	AAA	1.9
2.46Y	102582279.IB	25 义乌国资 MTN003	AAA	1.91
2.46Y	102582312.IB	25 融汇财富 MTN001	AA+	2.09
2.46Y	102582312.IB	25 融汇财富 MTN001	AA+	2.09
2.46Y	102582312.IB	25 融汇财富 MTN001	AA+	2.09
2.46Y	102582312.IB	25 融汇财富 MTN001	AA+	2.09
2.48Y(休 1)	102582483.IB	25 京国资 MTN006	AAA	1.85
2.48Y(休 1)	102582483.IB	25 京国资 MTN006	AAA	1.85
2.52Y	102582712.IB	25 荣盛 MTN001(科创债)	AAA	2.27
2.56Y	102580336.IB	25 电网 MTN001	AAA	99.9287 净价
2.56Y	102580336.IB	25 电网 MTN001	AAA	99.9287 净价
2.56Y	102580354.IB	25 电网 MTN002	AAA	99.9287 净价
2.56Y	102580354.IB	25 电网 MTN002	AAA	99.9287 净价
2.64Y	102382110.IB	23 常城建 MTN005	AAA	1.91
2.8Y	102382663.IB	23 国联 MTN008	AAA	1.91
2.81Y	102382742.IB	23 北控水务 MTN002	AAA	1.93
2.83Y(休 1)	102584352.IB	25 津城建 MTN011	AAA	2.2
2.84Y	102382915.IB	23 汇金 MTN006B	AAA	1.84
2.84Y	102382915.IB	23 汇金 MTN006B	AAA	1.84
2.84Y	102382915.IB	23 汇金 MTN006B	AAA	1.84
2.84Y	102382915.IB	23 汇金 MTN006B	AAA	1.84
2.9Y	102584838.IB	25 大众汽车 MTN002B(BC)	AAA	2.085
2.92Y(休 2)	102584953.IB	25 河钢集 MTN023	AAA	2.12
2.97Y	102585212.IB	25 广汽集 MTN001(科创债)	AAA	1.93
2.97Y	102585212.IB	25 广汽集 MTN001(科创债)	AAA	1.93
2.97Y	102585212.IB	25 广汽集 MTN001(科创债)	AAA	1.93
2.97Y	102585212.IB	25 广汽集 MTN001(科创债)	AAA	1.93
2.98Y	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
3.07Y+NY	102480233.IB	24 陕延油 MTN003	AAA	2.16 行权
3.25Y	102481184.IB	24 渝惠通 MTN001	AA+	2.31
3.25Y	102481184.IB	24 渝惠通 MTN001	AA+	2.31
3.36Y(休 1)	102481882.IB	24 新乡投资 MTN002	AA+	2.23
3.42Y(休 1)	102482060.IB	24 津城建 MTN020B	AAA	2.32
3.42Y(休 1)	102482060.IB	24 津城建 MTN020B	AAA	2.32
3.58Y	102483211.IB	24 陕投集团 MTN004	AAA	2.05

3.58Y	102483211.IB	24 陕投集团 MTN004	AAA	2.05
3.58Y	102483211.IB	24 陕投集团 MTN004	AAA	2.05
3.64Y	102483528.IB	24 株国投 MTN005	AA+	2.5
3.64Y	102483528.IB	24 株国投 MTN005	AA+	2.5
3.68Y	102483908.IB	24 金华城投 MTN001	AA+	2.175
3.68Y	102483908.IB	24 金华城投 MTN001	AA+	2.175
3.83Y	102484520.IB	24 南京国投 MTN001	AAA	2.01
3.83Y	102484520.IB	24 南京国投 MTN001	AAA	2.01
3.83Y	102484531.IB	24 南航股 MTN012	AAA	2.01
3.93Y	102485173.IB	24 诚通控股 MTN014(稳增长扩投资专项债)	AAA	1.99
4.17Y(休 1)	102580743.IB	25 汇金 MTN001	AAA	1.985
4.17Y(休 1)	102580743.IB	25 汇金 MTN001	AAA	1.985
4.17Y(休 1)	102580743.IB	25 汇金 MTN001	AAA	1.985
4.17Y(休 1)	102580743.IB	25 汇金 MTN001	AAA	1.985
4.17Y(休 1)	102580743.IB	25 汇金 MTN001	AAA	1.985
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	2
4.71Y	102583816.IB	25 汇金 MTN005	AAA	2
4.71Y	102583816.IB	25 汇金 MTN005	AAA	2
4.72Y(休 1)	102501586.IB	25 粤电发 MTN002	AAA	2.05
4.72Y(休 1)	102583863.IB	25 光大集团 MTN006A	AAA	2
4.74Y(休 1)	102583993.IB	25 山东机场 MTN001	AAA	2.2
4.81Y	102501642.IB	25 光大集团 MTN007A	AAA	2
4.81Y	102501642.IB	25 光大集团 MTN007A	AAA	2
4.9Y	102584957.IB	25 南电 MTN018	AAA	2
4.9Y	102584985.IB	25 南电 MTN019	AAA	2
4.9Y	102584985.IB	25 南电 MTN019	AAA	2
4.9Y	102584985.IB	25 南电 MTN019	AAA	2
4.97Y(休 1)	102585226.IB	25 南昌轨交 MTN003	AAA	2.13
4.98Y	102585334.IB	25 南电 MTN021(科创债)	AAA	2
4.98Y	102585334.IB	25 南电 MTN021(科创债)	AAA	2
4.98Y	102585337.IB	25 南电 MTN020(科创债)	AAA	100.00 净价
5Y	102585325.IB	25 渝江北嘴 MTN002	AA+	2.35
5Y	102585325.IB	25 渝江北嘴 MTN002	AA+	2.36
8.53Y	102482881.IB	24 光大集团 MTN004B	AAA	2.35
8.82Y(休 2)	102484465.IB	24 蜀道投资 MTN014	AAA	2.53
9.25Y	102581358.IB	25 电网 MTN017	AAA	2.365
9.25Y	102581378.IB	25 电网 MTN015	AAA	2.365
9.33Y	102581808.IB	25 电网 MTN019	AAA	2.365
9.33Y	102581808.IB	25 电网 MTN019	AAA	2.365
9.42Y(休 2)	102582144.IB	25 苏国信 MTN003	AAA	2.42
9.42Y(休 1)	102582164.IB	25 南电 MTN009	AAA	2.365
9.58Y	102583043.IB	25 南电 MTN012	AAA	2.365
9.9Y	102584816.IB	25 国新控股 MTN002(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.44
9.9Y	102584816.IB	25 国新控股 MTN002(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.44
9.9Y	102584816.IB	25 国新控股 MTN002(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.44
9.9Y	102584816.IB	25 国新控股 MTN002(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.44
9.96Y	102585170.IB	25 国新控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.44

9.96Y	102585170.IB	25 国新控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.44
9.96Y	102585170.IB	25 国新控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.44
9.96Y	102585170.IB	25 国新控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.44
9.96Y	102585170.IB	25 国新控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.44
9.96Y	102585170.IB	25 国新控股 MTN003(稳增长扩投资专项债)	AAA	2.44
13.8Y	102400985.IB	24 粤电发 MTN004B	AAA	2.58
13.83Y	102484558.IB	24 粤电发 MTN005	AAA	2.58
19.9Y	102584788.IB	25 皖投集 MTN004(科创债)	AAA	2.72
19.9Y	102584788.IB	25 皖投集 MTN004(科创债)	AAA	2.72

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（%）
95D+NY	2120019.IB	21 河北银行永续债 01	AAA	1.79 行权
109D	2328009.IB	23 中信银行 01	AAA	1.595
145D+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	1.68 行权
145D+NY	2128019.IB	21 中国银行永续债 01	AAA	1.68 行权
221D+NY(休 1)	210316.IB	21 进出 16	--/--	1.7 行权
228D+5Y(休 1)	2128025.IB	21 建设银行二级 01	AAA	1.73 行权
242D+5Y(休 2)	2128028.IB	21 邮储银行二级 01	AAA	1.74 行权
305D+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	1.755 行权
305D+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	1.755 行权
305D+5Y(休 2)	2128032.IB	21 兴业银行二级 01	AAA	1.76 行权
319D+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	1.755 行权
319D+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	1.755 行权
319D+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	1.755 行权
319D+5Y(休 1)	2128033.IB	21 建设银行二级 03	AAA	1.755 行权
326D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.76 行权
326D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.76 行权
326D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.76 行权
326D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.76 行权
326D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.76 行权
326D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.76 行权
326D+5Y(休 1)	2128039.IB	21 中国银行二级 03	AAA	1.76 行权
355D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.76 行权
355D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.76 行权
355D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.76 行权
355D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.76 行权
355D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.76 行权
355D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.76 行权
355D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.76 行权
355D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.76 行权
355D+5Y	2128051.IB	21 工商银行二级 02	AAA	1.76 行权
1.07Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	1.76 行权
1.07Y+NY	2228001.IB	22 邮储银行永续债 01	AAA	1.76 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	1.765 行权
1.08Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.08Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.765 行权

1.08Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.08Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.08Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.08Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.08Y+5Y(休 2)	2228006.IB	22 中国银行二级 01	AAA	1.77 行权
1.16Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	1.79 行权
1.16Y+NY	2228011.IB	22 农业银行永续债 01	AAA	1.79 行权
1.17Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.17Y+5Y	2228014.IB	22 交通银行二级 01	AAA	1.765 行权
1.19Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	1.69
1.19Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	1.69
1.19Y	212380032.IB	24 浦发银行债 01	AAA	1.7
1.2Y+5Y	2228017.IB	22 邮储银行二级 01	AAA	1.77 行权
1.23Y	212480004.IB	24 华夏银行债 01	AAA	1.69
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
1.3Y+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	1.79 行权
1.34Y	212480010.IB	24 长沙银行债 01	AAA	1.735
1.39Y+1Y	312400001.IB	24 工行 TLAC 非资本债 01A	AAA	1.79 行权
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
1.42Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	1.705
1.42Y	212480013.IB	24 交行债 01	AAA	1.705
1.48Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	1.80 行权
1.48Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	1.80 行权
1.48Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	1.805 行权
1.48Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	1.805 行权
1.48Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	1.805 行权
1.48Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	1.805 行权
1.48Y+5Y	2228039.IB	22 建设银行二级 01	AAA	1.805 行权
1.49Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.815 行权
1.49Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.815 行权
1.49Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.815 行权
1.49Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.815 行权
1.49Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.815 行权
1.49Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.815 行权
1.49Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.815 行权
1.49Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.815 行权
1.49Y+5Y	2228041.IB	22 农业银行二级 01	AAA	1.815 行权
1.53Y+5Y	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	AAA	1.84 行权
1.53Y+5Y	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	AAA	1.84 行权
1.53Y+5Y	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	AAA	1.84 行权
1.53Y+5Y	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	AAA	1.84 行权
1.55Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.72
1.55Y	212400007.IB	24 中信银行债 01	AAA	1.72
1.61Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.855 行权
1.61Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.855 行权
1.61Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.855 行权
1.61Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.855 行权
1.61Y+5Y	092280033.IB	22 宁波银行二级资本债 01	AAA	1.855 行权
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	1.815 行权
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	1.815 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	1.835 行权
1.66Y+5Y(休 1)	092280065.IB	22 工行二级资本债 03A	AAA	1.835 行权
1.66Y+5Y(休 1)	092280065.IB	22 工行二级资本债 03A	AAA	1.835 行权
1.66Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	1.73
1.66Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	1.73
1.66Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	1.73
1.66Y	212480050.IB	24 光大银行债 02	AAA	1.73
1.67Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	1.845 行权
1.67Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	1.845 行权
1.67Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	1.845 行权
1.67Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	1.845 行权
1.67Y+5Y	092280069.IB	22 华夏银行二级资本债 01	AAA	1.845 行权
1.68Y+NY	092280083.IB	22 建行永续债 01	AAA	1.84 行权
1.71Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA	1.755
1.71Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA	1.755
1.71Y	212480021.IB	24 浙商银行债 01	AAA	1.755
1.75Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	1.85 行权
1.75Y+5Y	092200008.IB	22 农行二级资本债 02A	AAA	1.85 行权
1.75Y	212400010.IB	24 中原银行小微债 01	AAA	1.85
1.84Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	1.855 行权
1.84Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	1.855 行权
1.84Y+5Y	092280108.IB	22 中行二级资本债 02A	AAA	1.86 行权
1.85Y(休 2)	212400012.IB	24 交行债 03BC	AAA	1.735
1.87Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	1.86 行权
1.87Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	1.86 行权
1.87Y+5Y(休 1)	092280131.IB	22 建行二级资本债 02A	AAA	1.86 行权
1.89Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	1.86 行权
1.89Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	1.86 行权
1.89Y+5Y	092280139.IB	22 交行二级资本债 02A	AAA	1.86 行权
2.16Y(休 1)	212580003.IB	25 民生银行债 01	AAA	1.78
1.98Y+1Y	312410010.IB	24 工行 TLAC 非资本绿债 01(BC)	AAA	1.80 行权
1.99Y+5Y	232280007.IB	22 工行二级资本债 05A	AAA	1.875 行权
2.15Y	212580001.IB	25 浙商银行债 01A	AAA	1.775
2.16Y	2520001.IB	25 北京银行小微债 01	AAA	1.77
2.16Y	2520001.IB	25 北京银行小微债 01	AAA	1.77
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	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	1.895 行权
2.24Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	1.90 行权
2.24Y+5Y	232380004.IB	23 农行二级资本债 01A	AAA	1.90 行权
2.25Y(休 1)	2520004.IB	25 北京银行 01	AAA	1.78
2.26Y	2528006.IB	25 中信银行小微债	AAA	1.76
2.26Y	2528006.IB	25 中信银行小微债	AAA	1.76
2.26Y	2528006.IB	25 中信银行小微债	AAA	1.76
2.27Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA	2.00 行权
2.27Y+5Y	232380008.IB	23 广州农商行二级资本债 01	AAA	2.00 行权
2.31Y	2520005.IB	25 厦门银行绿色债 01	AAA	1.82
2.34Y(休 5)	212580009.IB	25 渤海银行债 01	AAA	1.86
2.4Y(休 1)	332580005.IB	25 浙商银行科创债 01BC	AAA	1.785
2.48Y(休 1)	2520019.IB	25 杭州银行 01	AAA	1.79
2.54Y	212580018.IB	25 光大银行债 02	AAA	1.77
2.54Y	212580018.IB	25 光大银行债 02	AAA	1.77

[illegible]

3.12Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.16 行权
3.12Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.16 行权
3.12Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.16 行权
3.12Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.16 行权
3.12Y+5Y(休 1)	232480003.IB	24 恒丰银行二级资本债 01	AAA	2.16 行权
3.28Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	1.965 行权
3.28Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	1.97 行权
3.28Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	1.97 行权
3.28Y+5Y(休 2)	232480008.IB	24 中行二级资本债 02A	AAA	1.97 行权
3.32Y+5Y	232480010.IB	24 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.0475 行权
3.32Y+5Y	232480010.IB	24 浙商银行二级资本债 01	AAA	2.0475 行权
3.33Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.09 行权
3.33Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.095 行权
3.33Y+NY	242480002.IB	24 兴业银行永续债 01	AAA	2.1 行权
3.33Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.09 行权
3.33Y+NY	242400007.IB	24 中信银行永续债 01	AAA	2.09 行权
3.34Y+5Y(休 2)	232400014.IB	24 民生银行二级资本债 01	AAA	2.215 行权
3.4Y+1Y	312410002.IB	24 中行 TLAC 非资本债 01B	AAA	2.00 行权
3.41Y+5Y	232480020.IB	24 兴业银行二级资本债 01	AAA	2.035 行权
3.44Y+NY(休 1)	242400008.IB	24 江苏银行永续债 01	AAA	2.145 行权
3.44Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.07 行权
3.44Y+NY	242400009.IB	24 农行永续债 02	AAA	2.07 行权
3.46Y+NY	242480004.IB	24 华夏银行永续债 01	AAA	2.145 行权
3.49Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.145 行权
3.49Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.145 行权
3.49Y+NY	242400011.IB	24 广发银行永续债 01	AAA	2.145 行权
3.53Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.00 行权
3.53Y+5Y(休 2)	232480033.IB	24 建行二级资本债 02A	AAA	2.00 行权
3.53Y+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	2.06 行权
3.54Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.085 行权
3.54Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.085 行权
3.54Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.085 行权
3.54Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.085 行权
3.54Y+5Y	232480035.IB	24 平安银行二级资本债 01A	AAA	2.085 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	2.085 行权
3.59Y+NY	242480008.IB	24 中行永续债 01	AAA	2.1 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
3.64Y+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	2.025 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	2.07 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	2.07 行权
3.65Y+NY(休 1)	242400016.IB	24 民生银行永续债 01	AAA	2.35 行权
3.65Y+NY	242400018.IB	24 北京农商行永续债 01	AAA	2.22 行权
3.66Y+5Y	232480054.IB	24 重庆银行二级资本债 01	AAA	2.17 行权
3.66Y+5Y	232480054.IB	24 重庆银行二级资本债 01	AAA	2.175 行权
3.67Y+NY(休 1)	242400019.IB	24 江苏银行永续债 02	AAA	2.175 行权
3.67Y+NY(休 1)	242400019.IB	24 江苏银行永续债 02	AAA	2.175 行权
3.67Y+NY(休 1)	242400019.IB	24 江苏银行永续债 02	AAA	2.175 行权
3.67Y+NY(休 1)	242400019.IB	24 江苏银行永续债 02	AAA	2.18 行权

[illegible]

4.4Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.4Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.4Y+NY(休 1)	242580012.IB	25 建行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.4Y+NY	242580014.IB	25 北京银行永续债 01	AAA	2.275 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.125 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.125 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	2.14 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.14 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.1425 行权
4.42Y+5Y(休 2)	232580012.IB	25 中行二级资本债 01BC	AAA	2.1425 行权
4.42Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC	AAA	2.24 行权
4.42Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC	AAA	2.24 行权
4.42Y+NY	242580015.IB	25 招商银行永续债 02BC	AAA	2.24 行权
4.42Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.42Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.42Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.42Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.42Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.42Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.42Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.42Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.42Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.42Y+NY	242580017.IB	25 农行永续债 01BC	AAA	2.2 行权
4.46Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.25 行权
4.46Y+NY	242580019.IB	25 浦发银行永续债 01	AAA	2.255 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	2.135 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.135 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.145 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.145 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.145 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.145 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.145 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.145 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.145 行权
4.48Y+5Y(休 1)	232580016.IB	25 农行二级资本债 01A(BC)	AAA	2.145 行权
4.54Y+NY	242580026.IB	25 浦发银行永续债 02	AAA	2.25 行权
4.54Y+NY	242580026.IB	25 浦发银行永续债 02	AAA	2.25 行权
4.54Y+NY	242580026.IB	25 浦发银行永续债 02	AAA	2.25 行权
4.54Y+NY	242580026.IB	25 浦发银行永续债 02	AAA	2.25 行权
4.54Y+NY	242580026.IB	25 浦发银行永续债 02	AAA	2.25 行权
4.54Y+NY	242580026.IB	25 浦发银行永续债 02	AAA	2.25 行权
4.55Y+5Y(休 2)	232580022.IB	25 工行二级资本债 03BC	AAA	2.1475 行权
4.58Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.205 行权
4.58Y+NY	242580029.IB	25 中行永续债 01BC	AAA	2.2125 行权
4.67Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.245 行权
4.67Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.245 行权
4.67Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.2475 行权
4.67Y+NY	242580035.IB	25 中行永续债 02BC	AAA	2.25 行权
4.71Y+NY	242580038.IB	25 兴业银行永续债 02BC	AAA	2.315 行权
4.71Y+NY	242580038.IB	25 兴业银行永续债 02BC	AAA	2.315 行权
4.71Y+NY	242580038.IB	25 兴业银行永续债 02BC	AAA	2.315 行权
4.73Y+5Y	232580035.IB	25 农行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.205 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	2.2525 行权
4.88Y+NY	242580048.IB	25 长沙银行永续债 01	AAA	2.48 行权
4.88Y+NY	242580048.IB	25 长沙银行永续债 01	AAA	2.48 行权
4.9Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.9Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.9Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.9Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.9Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.9Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.9Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2175 行权
4.9Y+5Y	232580046.IB	25 农行二级资本债 04A(BC)	AAA	2.2225 行权
4.92Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.2125 行权
4.92Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.2125 行权
4.92Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.2125 行权
4.92Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.215 行权
4.92Y+5Y	232580050.IB	25 中行二级资本债 02BC	AAA	2.22 行权
4.92Y+NY	242580057.IB	25 杭州银行永续债 02	AAA	2.385 行权
4.92Y+NY	242580057.IB	25 杭州银行永续债 02	AAA	2.385 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2125 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2125 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2125 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2125 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.215 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.215 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2175 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2175 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2175 行权
4.95Y+5Y(休 2)	232580054.IB	25 建行二级资本债 03BC	AAA	2.2175 行权
4.96Y+NY	242580063.IB	25 上海银行永续债 01	AAA	2.405 行权
4.96Y+NY	242580063.IB	25 上海银行永续债 01	AAA	2.405 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.22 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.22 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.22 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.22 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.22 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.22 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.22 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.22 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.22 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.22 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.222 行权
5Y+5Y	232580067.IB	25 中行二级资本债 03A(BC)	AAA	2.222 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
6.07Y+5Y	2228005.IB	22 工商银行二级 02	AAA	2.29 行权
8.64Y+5Y	232480053.IB	24 浦发银行二级资本债 01B	AAA	2.53 行权
9.9Y+5Y	232580047.IB	25 农行二级资本债 04B(BC)	AAA	2.53 行权
15D	524303.SZ	25 广发 D7	AAA	1.63
21D	240468.SH	24 方正 G1	AAA	1.68
21D	240468.SH	24 方正 G1	AAA	1.68
26D+5Y	175646.SH	21 蓉高 01	AAA	1.71 行权

35D	151140.SH	19 双龙 01	AA+	2.6
42D	257434.SH	25 招证 F3	AAA	1.66
61D+2Y	138970.SH	23 济城 G3	AAA	1.50 行权
76D	032100300.IB	21 青岛海创 PPN001	AA+	2.4
76D	240694.SH	24 方正 G2	AAA	1.63
95D+NY	148231.SZ	23 鞍钢 Y1	AAA	1.8 行权
95D+5Y(休 1)	2123007.IB	21 阳光人寿	AAA	2.00 行权
95D+5Y(休 1)	2123007.IB	21 阳光人寿	AAA	2.00 行权
123D+1.99Y	032380399.IB	23 拉萨城投 PPN001	AA+	1.76 行权
167D+5Y	2123010.IB	21 中信保诚人寿	AAA	1.80 行权
172D	149513.SZ	21 中海 02	AAA	1.88
187D	259123.SH	25 景旅 D4	AA+	2.04
200D+3Y	148372.SZ	23 国际 P1	AAA	1.67 行权
211D+NY	115659.SH	一航 YV01	AAA	1.8 行权
220D(休 1)	188471.SH	21 两江 02	AAA	1.78
220D(休 1)	188471.SH	21 两江 02	AAA	1.78
220D(休 1)	188471.SH	21 两江 02	AAA	1.78
223D	188516.SH	21 亦庄 05	AAA	1.73
249D+363D(休 1)	259857.SH	25 恒业 07	AA+	2.12 行权
293D	197221.SH	21 济轨 01	AAA	1.8
293D	197221.SH	21 济轨 01	AAA	1.8
293D	197221.SH	21 济轨 01	AAA	1.8
295D	115985.SH	23 信投 G4	AAA	1.65
316D	240150.SH	23 浙金 03	AAA	1.7
328D	134081.SZ	24 国证 07	AAA	1.69
334D	240335.SH	23 招证 11	AAA	1.66
334D	240335.SH	23 招证 11	AAA	1.66
361D+2Y	253228.SH	23 经控 K1	AA+	2.03 行权
1.05Y+NY	185245.SH	22 中金 Y1	AAA	1.76 行权
1.05Y+NY	185245.SH	22 中金 Y1	AAA	1.77 行权
1.07Y	253608.SH	24 银河 F1	AAA	1.71
1.07Y	253608.SH	24 银河 F1	AAA	1.71
1.07Y	253608.SH	24 银河 F1	AAA	1.71
1.07Y	253608.SH	24 银河 F1	AAA	1.71
1.07Y	253608.SH	24 银河 F1	AAA	1.71
1.08Y	240517.SH	24 兴业 01	AAA	1.69
1.08Y	253688.SH	24 圆山 01	AA	2.02
1.08Y	253688.SH	24 圆山 01	AA	2.02
1.12Y(休 9)	253872.SH	24 漳交 01	AAA	1.91
1.12Y(休 9)	253872.SH	24 漳交 01	AAA	1.91
1.12Y(休 9)	253872.SH	24 漳交 01	AAA	1.91
1.12Y(休 9)	253872.SH	24 漳交 01	AAA	1.91
1.17Y	148606.SZ	24 申证 01	AAA	1.67
1.18Y	032480206.IB	24 武汉开投 PPN002	AA+	2.31
1.18Y	032480206.IB	24 武汉开投 PPN002	AA+	2.31
1.19Y+2Y(休 1)	240635.SH	24 中金 G2	AAA	1.67 行权
1.24Y+NY	240782.SH	24 沪建 Y1	AAA	1.96 行权
1.24Y+NY	240782.SH	24 沪建 Y1	AAA	1.96 行权
1.24Y+NY	240782.SH	24 沪建 Y1	AAA	1.96 行权
1.33Y(休 1)	032480443.IB	24 西岸金融 PPN002	AA	2.13
1.36Y	2280221.IB	22 启东国投小微债	AA+	1.87
1.37Y	149914.SZ	22 中海 04	AAA	2.14
1.37Y	149914.SZ	22 中海 04	AAA	2.14
1.41Y(休 1)	243047.SH	25 财通 K1	AAA	1.67
1.43Y+2Y	254867.SH	24 漂水 F1	AA+	1.97 行权

1.55Y	524345.SZ	25 东莞 K1	AAA	1.75
1.55Y	524345.SZ	25 东莞 K1	AAA	1.75
1.55Y	524345.SZ	25 东莞 K1	AAA	1.75
1.55Y	524345.SZ	25 东莞 K1	AAA	1.75
1.56Y	184477.SH	22 龙微 01	AA	1.99
1.56Y	2422041.IB	24 中银消费金融债 03	AAA	1.86
1.56Y	2422041.IB	24 中银消费金融债 03	AAA	1.86
1.6Y+2Y	241356.SH	24 紫金 K2	A-	1.70 行权
1.61Y	143233.SH	17 东方债	AAA	1.76
1.63Y	134691.SZ	25 国证 12	AAA	1.9
1.63Y	134691.SZ	25 国证 12	AAA	1.9
1.66Y	182370.SH	22 桐城 01	AA+	2.01
1.67Y	152560.SH	20 应城债	AA	2.03
1.67Y	152560.SH	20 应城债	AA	2.03
1.72Y	2422052.IB	24 中银消费金融债 05	AAA	1.85
1.73Y(休 2)	243811.SH	25 华泰 G9	AAA	1.78
1.73Y(休 2)	243811.SH	25 华泰 G9	AAA	1.78
1.73Y(休 2)	243811.SH	25 华泰 G9	AAA	1.78
1.74Y	143301.SH	17 海通 03	AAA	1.74
1.74Y	143301.SH	17 海通 03	AAA	1.74
1.74Y	148074.SZ	22 广铁 G2	AAA	1.77
1.74Y	243832.SH	25 浙商 K1	AAA	1.725
1.81Y(休 2)	032481115.IB	24 黄石新投 PPN001	AA+	2.39
1.82Y	137944.SH	22 沪城 01	AAA	1.81
1.83Y	241820.SH	24 同辐 K1	AAA	1.74
1.87Y(休 2)	241830.SH	24 中泰 06	AAA	1.78
1.87Y(休 1)	244168.SH	25 中证 12	AAA	1.79
1.87Y(休 1)	244168.SH	25 中证 12	AAA	1.79
1.87Y+3Y(休 2)	184107.SH	21 厦居 02	AAA	1.89 行权
1.88Y+2Y(休 1)	256416.SH	24 江城 07	AAA	2.02 行权
1.89Y(休 1)	241944.SH	24 光证 G5	AAA	1.78
1.91Y(休 1)	242000.SH	24 方正 G5	AAA	1.84
1.91Y(休 1)	242027.SH	24 津投 27	AAA	1.94
1.92Y	241882.SH	24 北汽 02	AAA	1.95
1.95Y(休 1)	242071.SH	24 上控 02	AAA	1.95
1.99Y+2Y	032481634.IB	24 聊城财信 PPN001	AA+	2.22 行权
2.17Y(休 1)	138916.SH	23 华泰 G7	AAA	1.75
2.17Y(休 1)	257649.SH	25 吴中 01	AA	2.16
2.22Y+5Y(休 1)	272380002.IB	23 太平洋财险债 01	AAA	1.94 行权
2.23Y+2Y	032580218.IB	25 余杭城投 PPN003	AAA	2.035 行权
2.37Y	115347.SH	23 华泰 G9	AAA	1.77
2.41Y	134265.SZ	25 广交投 02	AA+	2.18
2.44Y(休 1)	243107.SH	25 电投 K2	AAA	1.75
2.47Y	243138.SH	25 华安 C1	AAA	2.07
2.5Y(休 2)	243227.SH	25 京投 K1	AAA	1.73
2.5Y	243233.SH	25 创投 K1	AAA	1.8
2.52Y(休 2)	243238.SH	25 电投 K5	AAA	1.75
2.52Y(休 2)	243238.SH	25 电投 K5	AAA	1.75
2.58Y+NY	115689.SH	铁工 YK04	AAA	1.94 行权
2.58Y+NY	115689.SH	铁工 YK04	AAA	1.94 行权
2.58Y	243299.SH	25 苏资 K1	AAA	2.1
2.67Y+2Y(休 1)	032580556.IB	25 余杭城投 PPN008	AAA	2.09 行权
2.67Y+NY	115879.SH	铁工 YK08	AAA	1.95 行权
2.7Y+5Y	272380011.IB	23 人寿再保险资本补充债 01	AAA	2.06 行权
2.72Y+5Y	272380013.IB	23 建信人寿资本补充债 01	AAA	2.05 行权

2.72Y+5Y	272380013.IB	23 建信人寿资本补充债 01	AAA	2.05 行权
2.72Y+5Y	272380013.IB	23 建信人寿资本补充债 01	AAA	2.05 行权
2.76Y	032580641.IB	25 泰州城投 PPN002	AAA	2.11
2.8Y(休 2)	243940.SH	建材 K13	AAA	1.76
2.82Y	280302.SH	25 株国 19	AA+	2.41
2.84Y+2Y(休 1)	243996.SH	25 昌投 G1	AA+	2.20 行权
2.84Y+2Y(休 1)	243996.SH	25 昌投 G1	AA+	2.20 行权
2.85Y+NY	244121.SH	电投 KY15	AAA	1.99 行权
2.92Y	244241.SH	25 交租 K1	AAA	2.05
2.92Y+2Y	524564.SZ	25 桂交 04	AAA	2.04 行权
2.95Y+2Y	032580796.IB	25 余杭城投 PPN013	AAA	2.13 行权
2.95Y+2Y	032580796.IB	25 余杭城投 PPN013	AAA	2.13 行权
2.97Y	244416.SH	25GTHTK5	AAA	1.79
2.97Y	244416.SH	25GTHTK5	AAA	1.79
2.97Y	244416.SH	25GTHTK5	AAA	1.79
2.98Y(休 2)	244378.SH	25 皖投 09	AAA	1.9
3.25Y	240803.SH	24 兵器 K1	AAA	1.77
3.42Y	254857.SH	24 株高 03	AA+	2.67
3.47Y(休 3)	2280245.IB	22 丽水管廊债 01	AA	2.28
3.55Y+5Y	272400005.IB	24 平安产险资本补充债 01	AAA	2.19 行权
3.55Y+5Y	272400005.IB	24 平安产险资本补充债 01	AAA	2.19 行权
3.75Y(休 1)	255944.SH	24 濮阳 06	AA+	2.72
3.85Y+NY	241868.SH	延长 KY18	AAA	2.1 行权
3.9Y	032481531.IB	24 宜昌城发 PPN004	AA+	2.39
3.9Y	032481531.IB	24 宜昌城发 PPN004	AA+	2.39
3.93Y+5Y	272480010.IB	24 人民财险资本补充债 01	AAA	2.195 行权
3.93Y+5Y	272480010.IB	24 人民财险资本补充债 01	AAA	2.195 行权
4.2Y	242456.SH	25 甬投 01	AAA	2.04
4.5Y	243236.SH	25 中铜 K1	AAA	1.94
4.54Y+NY	243295.SH	中电 YK02	AAA	2.24 行权
4.54Y+NY	243295.SH	中电 YK02	AAA	2.24 行权
4.54Y+NY	243295.SH	中电 YK02	AAA	2.24 行权
4.76Y(休 1)	134525.SZ	25 吉安 03	AA+	2.66
4.76Y(休 1)	134525.SZ	25 吉安 03	AA+	2.66
4.81Y	243916.SH	25 动能 04	AAA	2.25
4.87Y	524513.SZ	25 川高 K2	AAA	2.04
4.88Y	244183.SH	25 国电 K5	AAA	1.9
4.92Y(休 1)	244262.SH	25 中铜 K2	AAA	1.96
4.96Y+5Y	272580009.IB	25 平安人寿资本补充债 01	AAA	2.39 行权
4.96Y+5Y	272580009.IB	25 平安人寿资本补充债 01	AAA	2.39 行权
4.97Y+NY(休 1)	244384.SH	葛洲 YK13	AAA	2.21 行权
4.97Y+NY(休 1)	244384.SH	葛洲 YK13	AAA	2.21 行权
4.97Y+NY(休 1)	244384.SH	葛洲 YK13	AAA	100.00 净价
7.5Y(休 1)	148343.SZ	23 深铁 05	AAA	2.8
8.12Y(休 1)	271134.SH	24 电建 01	AAA	2.32
8.2Y	240662.SH	24 中化 02	AAA	2.63
8.2Y	240662.SH	24 中化 02	AAA	2.64
8.2Y	240662.SH	24 中化 02	AAA	2.64
8.47Y	241134.SH	24 中化 07	AAA	2.64
8.53Y(休 2)	241146.SH	24 蜀道 01	AAA	2.5
8.56Y	241248.SH	24 中化 10	AAA	2.64
8.66Y	241472.SH	24 中化 12	AAA	2.64
9.88Y(休 2)	244141.SH	25 合轨 03	AAA	2.55
9.98Y	244417.SH	25 交建 K1	AAA	2.4
9.98Y	244417.SH	25 交建 K1	AAA	2.4

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。