



西部担保  
WEST GUARANTEE

# 债券市场资讯

担保事业一部编写

2020年10月21日/第122期/总第122期

# 目录



|         |    |
|---------|----|
| 债市要闻速览  | 02 |
| 利率走势分析  | 05 |
| 机构看债市   | 06 |
| 信用债发行统计 | 08 |
| 信用债违约统计 | 09 |
| 附录      | 10 |

---

## 债市要闻速览

❖ 香港万得通讯社报道，10月14日，中华人民共和国财政部在香港特别行政区发行60亿美元主权债券。

**点评：**本次发行美元主权债券是财政部2017年重启美元主权债券发行后连续第四年发行，也是近年来首次采用Reg S和144A双规则发行，国际评级公司给予了信用评级。从发行情况看，投资者认购踊跃，订单规模达到发行量的4.7倍，所有期限债券均实现负5-10个基点的新发行溢价。此次发行新引入了美国境内合格投资者，进一步扩宽了投资者群体，国际组织、中央银行及区域货币当局投资踊跃，养老基金、商业银行、保险公司、资管公司、基金公司等积极参与了发行，并在地域和类型上体现出良好的分布。

❖ 香港万得通讯社报道，央行回应“未来降息和降准空间”称，利率水平与当前经济基本面总体是匹配的，下一阶段将根据形势变化综合运用多种货币政策工具，保持流动性合理充裕，支持货币供应量和社会融资规模合理增长，为确保全面建成小康社会和经济高质量发展提供良好的货币环境。

**点评：**今年以来，人民银行主要通过下调法定准备金率、中期借贷便利操作和公开市场操作，主动投放长期、中期和短期流动性，调节银行体系流动性的能力进一步增强。今年以来，人民银行三次降准，共释放长期流动性1.75万亿元，支持货币信贷合理增长，满足了银行货币创造服务实体经济的需要。目前，从长期、短期、中期流动性来看，银行体系流动性都保持在合理充裕的水平。

关于利率水平。今年前四个月央行因经济形势变化特别是疫情冲击，前瞻性引导公开市场操作中标利率、中期借贷便利中标利率下行30个基点，带动一年期的贷款市场报价利率LPR也同步下行，并推动贷款利率明显下行。近几个月来随着疫情得到有效控制，国内经济复苏态势良好，央行的政策利率和贷款市场报价利率LPR均保持稳定，市场利率围绕央行政策利率运行，利率水平与当前的经济基本面总体是匹配的。下一阶段人民银行将根据形势变化综合运用多种货币政

## 债市要闻速览

策工具，保持流动性合理充裕，支持货币供应量和社会融资规模合理增长，为确保全面建成小康社会和经济高质量发展提供良好的货币环境。

❖ 香港万得通讯社报道，财政部网站信息显示，今年以来，根据党中央、国务院决策部署，财政部积极指导各地加快地方政府债券（以下称地方债）发行使用进度，促进积极的财政政策更加积极有为，为做好“六稳”工作、落实“六保”任务发挥了重要作用。

点评：截止今年9月底，地方债发行规模大幅增加，发行节奏更加优化，发行期限有所延长，发行利率明显降低，二级市场交易量有所增加，流动性进一步改善；下一步将加快地方债发行使用，确保新增专项债券10月底前发行完毕，努力推动完成全年经济社会发展目标任务。

❖ 香港万得通讯社报道，10月18日，国家发改委正式发布《深圳建设中国特色社会主义先行示范区综合改革试点首批授权事项清单》。

点评：首批授权事项清单共有六大类40条，其中要素市场化配置方面13条，包括推进创业板改革并试点注册制落地，建立新三板挂牌公司转板上市机制；推出深市股票股指期货，不断丰富股票股指期货产品体系；开展创新企业境内发行股票或存托凭证（CDR）试点，完善创新企业境内发行上市制度，推动具有创新引领示范作用的企业发行股票或存托凭证（CDR）并在深交所上市，强化创新企业信息披露，保护投资者合法权益等。

❖ 第一财经日报报道，随着“三道红线”正式实施日期的日渐逼近，房企正抓住最后的窗口期，与时间赛跑。数据显示，今年9月，房企境内债券融资同比上升逾三成，并连续三个月维持800亿元以上的高位；同期境外债发行虽然同比下降，但环比仍上涨逾两成。

点评：关于“三道红线”指标，即监管层提出的：房企剔除预收款后的资产负债率70%，净负债率100%，现金短债比为1倍。最早的信息显示，将于9

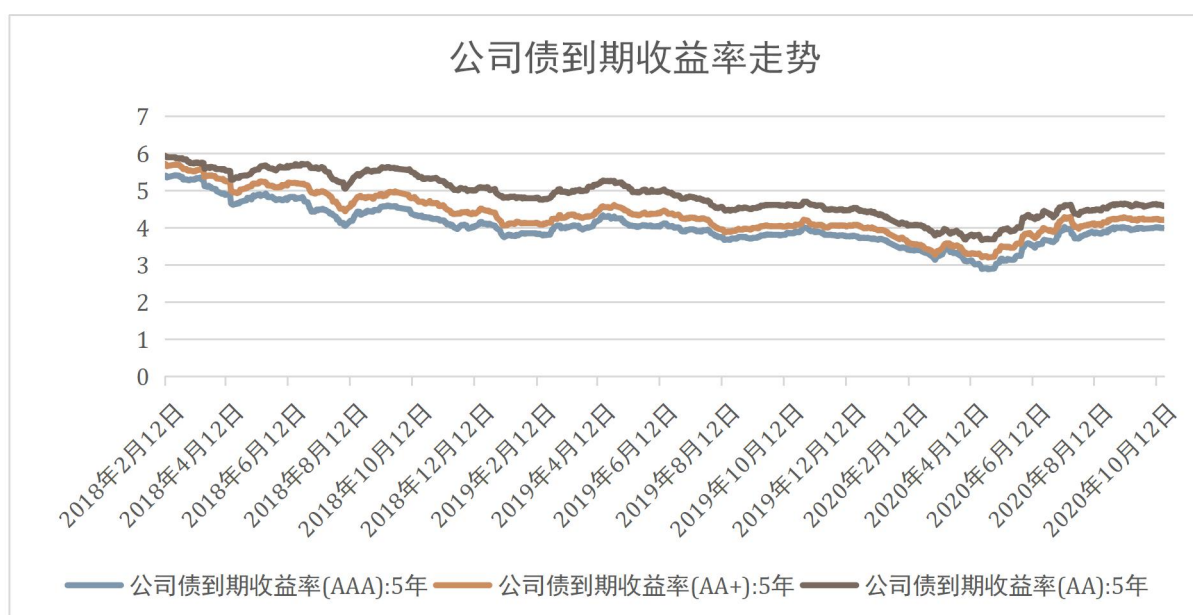
## 债市要闻速览

月起在 12 家房企试行，到明年初推广至所有规模房企，而排名较后的房企则采取总量控制的“一刀切”做法。根据国泰君安数据，截至 6 月末，三道红线均超标的“红色档”企业有 22 家，包括中国恒大、绿地集团、中南建设、金科股份、华夏幸福、富力地产等。

## 利率走势分析

2020年10月13日至10月20日期间，5年期AAA级小幅上升，AA+级、AA级公司债到期收益率则呈现下降趋势。10月20日5年期AAA级、AA+级、AA级公司债到期收益率分别较10月13日上升0.06bp至4.0064%、下降2.84bp至4.1996%、下降3.16bp至4.582%。

图表、公司债到期收益率走势图



数据来源：wind，西部担保整理

## ❖ 兴业证券：经济韧性延续期，债市防守反击时

四季度仍然是“经济好+政策稳”时期，长端利率债难有机会，仍属动荡区间。中短端机会需要负债端压力的实质性缓解，但信用债套息策略依然有效（回购市场稳定）。拉长时间看（明年1季度后），“政策稳+经济好”大概率会切换至“政策松+经济转弱”或“政策稳+经济转弱”，信用利差届时将提升，低等级信用债信用利差抬升高于高等级信用债，而此时利率债往往具有较好的投资机会。

几个维度看债券资产比价：1）相比权益资产，债券资产性价比明显抬升，只是债券收益率下行需要催化剂。2）横向比较看，中国债券收益率水平在国际上相当具有吸引力。3）相比银行贷款，扣除税收和风险资本占用后，债券价值明显提升。四季度债券配置价值凸显，但下行空间有限。在信用扩张高点过后，利率债与信用的性价比将逐步切换。

## ❖ 国盛证券：疫情冲击基本消退，如何看待经济与债市关系？

基本面对债市的压力有限，债市机会在积聚。终端需求存在下行压力将制约经济回升的高度，预计4季度GDP同比为5.3%左右，难以回到疫情前的水平。债市对经济基本面回升给的预期较足，经济基本面难以出现超预期强劲上行，因而对债市的影响有限。债市机会在逐步积聚。从资金面来看，目前央行货币政策保持中性，既不会收紧也难以放松。资金需求决定流动性紧平衡情况，流动性分层幅度。10月后政府债券融资下降将减少资金需求，流动性分层和流动性紧平衡情况将随之改善。而随着社融增速见顶，利率顶也将滞后出现。政府债券发行回落将带来社融增速在10月见顶，11-12月小幅下行，由于高基数和政府债券发行节奏放缓，明年上半年社融增速将快速回落。社融增速回落将减弱经济的回升预期，并解除对长端利率的压制，债市的机会将逐步显现。

## ❖ 兴业证券：信用供给知多少

## 机构看债市

20 年以来，在宽松的信用融资环境下信用债发行规模大幅增长，下半年随着债券市场调整有所回落。热闹过去后，未来一段时间的信用供给又将如何发展？回顾了前三季度信用债的发行情况，非金融行业信用债总发行规模达 9.2 万亿，到期规模 5.8 万亿，净融资额近 3.5 万亿。发行总量同比去年大幅走高，结构方面的分化仍未见显著改善，但由于融资环境的整体改善而有所趋缓。月度发行情况受到政策变动对融资环境以及成本的影响波动大。

展望未来，从到期量来看，20 年 4 季度信用债到期规模合计近 2.5 万亿，21 年 1 季度到期规模近 1.8 万亿，但前三季度净融资额合计已经达 3.5 万亿，短期内企业再融资压力较小。投资意愿方面，城投、电子、医药等较强，而消费相关的汽车、纺服、家电等下游行业尚未明显恢复。综上，短期内发行人发债融资的必要性仍有所下降，成本对于信用债发行意愿的影响权重上升。而现阶段信用债相比贷款的成本优势的成本优势已显著收窄。9 月份 AAA 级发行人净融资规模已经开始大幅转负，未来出于成本考虑高评级主体或将继续维持净流出的趋势。总体来看，未来 1-2 个季度信用债供给量或将小幅下降，月均 5000-6000 亿左右规模。但最终发行规模还可能受到需求变动、政策变动等方面的影响。

# 信用债发行统计

2020 年 10 月 13 日至 2020 年 10 月 20 日期间，信用债发行只数和发行规模分别为 358 只和 4,936.89 亿元。

图表、2020.10.13-2020.10.20 非金融信用债发行情况统计

| 债券品种   | 主体评级 | 发行只数 | 发行规模（亿元） | 发行利率区间      |
|--------|------|------|----------|-------------|
| 短期融资券  | ---  | 7    | 35.60    | 3.6%-5.7%   |
|        | AA+  | 24   | 136.00   | 2.1%-7.1%   |
|        | AAA  | 67   | 875.00   | 1.2%-5.6%   |
| 公司债    | AA   | 14   | 87.30    | 4.3%-7.5%   |
|        | AA+  | 13   | 94.00    | 3.75%-6.5%  |
|        | AAA  | 29   | 450.40   | 3.35%-5.8%  |
| 中期票据   | AA   | 6    | 32.00    | 3.9%-6.8%   |
|        | AA+  | 12   | 89.00    | 3.8%-6.15%  |
|        | AAA  | 22   | 290.40   | 3.7%-5.8%   |
| 企业债    | AA   | 1    | 7.90     | 4.89%       |
|        | AA+  | 1    | 8.00     | 5.08%       |
|        | AAA  | 6    | 102.00   | 3.72%-4.65% |
| 可转债    | A+   | 1    | 1.42     | 0.50%       |
|        | AA   | 2    | 22.30    | 0.30%       |
|        | AA-  | 4    | 22.78    | 0.40%       |
|        | AA+  | 1    | 20.00    | 0.20%       |
|        | AAA  | 1    | 160.00   | 0.20%       |
| 定向工具   | ---  | 3    | 10.00    | 6%          |
|        | AA   | 3    | 8.00     | 4.6%-6.9%   |
|        | AA+  | 6    | 44.20    | 4.28%-6.9%  |
|        | AAA  | 4    | 36.00    | 3.95%-5.3%  |
| 金融债    | ---  | 22   | 1,136.40 | 2.11%-4.21% |
|        | AA+  | 2    | 30.00    | 4.07%-4.26% |
|        | AAA  | 19   | 810.00   | 2.69%-4.73% |
| 资产支持证券 | ---  | 88   | 428.19   | 2.99%-15%   |
| 合计     |      | 358  | 4,936.89 |             |

数据来源：Wind，西部担保整理

## 信用债违约统计

2020 年 10 月 13 日至 2020 年 10 月 20 日期间，市场新增 3 只债券违约，发行总额 50.05 亿元，违约余额 49.5 亿元。

图表 3、2020.10.13-2020.10.20 信用债违约情况统计

| 名称             | 发生日期       | 事件摘要                                                                                             | 发行人          | 债券类型   | 债券余额（亿元） | 公司属性   |
|----------------|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------|--------|----------|--------|
| 17 巴安债         | 2020-10-19 | 因公司未与债券持有人达成债务和解                                                                                 | 上海巴安水务股份有限公司 | 一般公司债  | 4.00     | 民营企业   |
| 19 方正 MTN002   | 2020-10-15 | 北大方正已于 2020 年 2 月 19 日被北京一中院依法裁定进入重整程序，目前重整工作正在进行中，依据重整相关法律规定，北大方正不得个别清偿，“19 方正 MTN002”不能按期足额付息。 | 北大方正集团有限公司   | 一般中期票据 | 15.50    | 中央国有企业 |
| 15 中信国安 MTN003 | 2020-10-13 | 因流动资金紧张，截至 2020 年 10 月 13 日日终，发行人未能按照约定筹措足额付息资金，“15 中信国安 MTN003”未能按期足额偿付本息，已构成实质性违约。             | 中信国安集团有限公司   | 一般中期票据 | 30.00    | 公众企业   |

# 附录

## 2020.10.13-2020.10.20 债券发行明细

| 债券简称           | 债券类型   | 发行起始日      | 发行规模<br>(亿) | 发行<br>期限<br>(年) | 债券<br>评级 | 主体<br>评级 | 票面利<br>率(%) |
|----------------|--------|------------|-------------|-----------------|----------|----------|-------------|
| 天能转债           | 可转债    | 2020-10-21 | 7.00        | 6.00            | AA-      | AA-      | 0.4000      |
| 乐歌转债           | 可转债    | 2020-10-21 | 1.42        | 6.00            | A+       | A+       | 0.5000      |
| 蚁借 01C         | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 1.30        |                 |          |          |             |
| 长盛 01A         | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 13.50       | 0.58            |          |          |             |
| 蚁借 01A         | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 17.20       | 0.69            | AAA      |          |             |
| 蚁借 01B         | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 1.50        | 0.69            | AA+      |          |             |
| 20 花 04A2      | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 1.20        | 1.00            | AA+      |          |             |
| 20 花 04A1      | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 26.70       | 1.00            | AAA      |          |             |
| 20 花 04B       | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 2.10        | 1.00            |          |          |             |
| 荟享 044B        | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 0.30        | 1.00            |          |          |             |
| 荟享 044A        | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 8.90        | 1.00            |          |          |             |
| 健弘 07A         | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 8.50        | 2.92            | AAA      |          |             |
| 健弘 07C         | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 0.75        | 2.92            |          |          |             |
| 健弘 07B         | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 0.75        | 2.92            | AA+      |          |             |
| 20 裕丰 03       | 公司债    | 2020-10-20 | 1.80        | 3.00            | AA       | AA       | 7.5000      |
| 洽洽转债           | 可转债    | 2020-10-20 | 13.40       | 6.00            | AA       | AA       | 0.3000      |
| 鹏辉转债           | 可转债    | 2020-10-20 | 8.90        | 6.00            | AA       | AA       | 0.3000      |
| 19 国开 14(增 18) | 金融债    | 2020-10-20 | 30.00       | 3.00            |          |          | 2.9700      |
| 20 国开 07(增 9)  | 金融债    | 2020-10-20 | 50.00       | 3.00            |          |          | 3.0000      |
| 20 国开 12(增 13) | 金融债    | 2020-10-20 | 90.00       | 5.00            |          |          | 3.3400      |
| 20 国开 09(增 13) | 金融债    | 2020-10-20 | 30.00       | 7.00            |          |          | 3.3900      |
| 20 唯盈 2A1_bc   | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 16.00       | 0.84            | AAA      |          | 2.9900      |
| 20 唯盈 2A2_bc   | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 18.80       | 1.35            | AAA      |          | 3.0900      |
| 20 唯盈 2C_bc    | 资产支持证券 | 2020-10-20 | 4.40        | 3.51            |          |          |             |
| 20 京投债 01      | 企业债    | 2020-10-20 | 30.00       | 3.00            | AAA      | AAA      | 3.7200      |
| 弘德 02D         | 资产支持证券 | 2020-10-19 | 0.60        |                 |          |          |             |
| 20 中车 SCP017   | 短期融资券  | 2020-10-19 | 30.00       | 0.06            |          | AAA      | 1.9000      |
| 20 象屿 SCP016   | 短期融资券  | 2020-10-19 | 5.00        | 0.08            |          | AAA      | 2.1000      |
| 20 长城汽车 SCP005 | 短期融资券  | 2020-10-19 | 10.00       | 0.10            |          | AAA      | 1.4800      |
| 20 华能水电 SCP014 | 短期融资券  | 2020-10-19 | 10.00       | 0.16            |          | AAA      | 2.2000      |
| 20 中电路桥 SCP011 | 短期融资券  | 2020-10-19 | 10.00       | 0.23            |          | AAA      | 1.8500      |
| 20 中电投 SCP027  | 短期融资券  | 2020-10-19 | 10.00       | 0.24            |          | AAA      | 2.1000      |

# 附录

|                |        |            |       |      |     |     |        |
|----------------|--------|------------|-------|------|-----|-----|--------|
| 20 东兴证券 CP009  | 金融债    | 2020-10-19 | 20.00 | 0.24 | A-1 | AAA | 3.0000 |
| 20 平安租赁 SCP007 | 短期融资券  | 2020-10-19 | 15.00 | 0.29 |     | AAA | 2.5500 |
| 20 电网 SCP035   | 短期融资券  | 2020-10-19 | 40.00 | 0.49 |     | AAA | 2.4000 |
| 20 广汇汽车 SCP002 | 短期融资券  | 2020-10-19 | 4.00  | 0.74 |     | AA+ | 7.1000 |
| 弘德 02C         | 资产支持证券 | 2020-10-19 | 0.80  | 1.00 | A+  |     |        |
| 弘德 02A         | 资产支持证券 | 2020-10-19 | 17.80 | 1.00 | AAA |     |        |
| 弘德 02B         | 资产支持证券 | 2020-10-19 | 0.80  | 1.00 | AA+ |     |        |
| 20 高教投资 PPN002 | 定向工具   | 2020-10-19 | 1.00  | 2.00 |     | AA  | 6.9000 |
| 20 新都投资 PPN001 | 定向工具   | 2020-10-19 | 7.00  | 3.00 |     |     | 6.0000 |
| 20 昆交发         | 公司债    | 2020-10-19 | 5.00  | 5.00 |     | AA+ | 4.0000 |
| 20 忻州 02       | 公司债    | 2020-10-19 | 5.00  | 5.00 | AA  | AA  | 5.1800 |
| 20 农发 07(增 10) | 金融债    | 2020-10-19 | 23.70 | 3.00 |     |     | 3.0600 |
| 17 农发 12(增 18) | 金融债    | 2020-10-19 | 35.90 | 5.00 |     |     | 4.2100 |
| 20 农发 08(增 3)  | 金融债    | 2020-10-19 | 80.00 | 5.00 |     |     | 3.4500 |
| 霄驰 02 次        | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 0.45  |      |     |     |        |
| 锦河 07A         | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 8.80  |      | AAA |     |        |
| 锦河 07C         | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 1.20  |      |     |     |        |
| 20 南航集 SCP007  | 短期融资券  | 2020-10-16 | 20.00 | 0.08 |     | AAA | 1.6500 |
| 20 中建七局 SCP008 | 短期融资券  | 2020-10-16 | 5.00  | 0.08 |     | AAA | 1.4900 |
| 20 中电信 SCP013  | 短期融资券  | 2020-10-16 | 30.00 | 0.08 |     | AAA | 1.2000 |
| 20 赣粤 SCP007   | 短期融资券  | 2020-10-16 | 4.00  | 0.08 |     | AAA | 1.3400 |
| 20 伊利实业 SCP026 | 短期融资券  | 2020-10-16 | 10.00 | 0.08 |     | AAA | 1.6000 |
| 电惠融 1C         | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 0.01  | 0.20 |     |     |        |
| 电惠融 1A         | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 3.00  | 0.20 | AAA |     | 3.2000 |
| 20 东方证券 CP006  | 金融债    | 2020-10-16 | 30.00 | 0.24 | A-1 | AAA | 2.8800 |
| 20 华电江苏 SCP016 | 短期融资券  | 2020-10-16 | 7.00  | 0.24 |     | AAA | 1.9000 |
| 20 上海医药 SCP004 | 短期融资券  | 2020-10-16 | 25.00 | 0.25 |     | AAA | 2.4000 |
| 20 市北高新 SCP004 | 短期融资券  | 2020-10-16 | 6.00  | 0.25 |     | AAA | 1.6600 |
| 20 天风证券 CP006  | 金融债    | 2020-10-16 | 20.00 | 0.25 | A-1 | AAA | 3.4000 |
| 20 龙源电力 SCP011 | 短期融资券  | 2020-10-16 | 10.00 | 0.42 |     | AAA | 1.8000 |
| 20 望海潮 SCP001  | 短期融资券  | 2020-10-16 | 3.00  | 0.49 |     | AA+ | 2.7000 |
| 20 国联 SCP010   | 短期融资券  | 2020-10-16 | 5.00  | 0.49 |     | AAA | 2.5500 |
| 20 上海机场 SCP003 | 短期融资券  | 2020-10-16 | 10.00 | 0.49 |     | AAA | 2.2700 |
| 霄驰 02B         | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 0.60  | 0.59 | AA+ |     |        |
| 霄驰 02A         | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 13.50 | 0.59 | AAA |     |        |
| 霄驰 02C         | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 0.45  | 0.59 | A+  |     |        |

## 附录

|                 |        |            |       |      |     |     |        |
|-----------------|--------|------------|-------|------|-----|-----|--------|
| 20 宿迁经开 SCP004  | 短期融资券  | 2020-10-16 | 7.00  | 0.74 |     | AA  | 3.9000 |
| 20 长江开发 SCP003  | 短期融资券  | 2020-10-16 | 5.00  | 0.74 |     | AA  | 3.6000 |
| 20 乌经建 SCP001   | 短期融资券  | 2020-10-16 | 6.00  | 0.74 |     | AA+ | 3.5600 |
| 20 通盛 A         | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 3.30  | 0.92 | AAA |     |        |
| 20 然诺 ABN001 优先 | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 5.18  | 1.00 |     |     | 5.9000 |
| 20 阳煤 CP019     | 短期融资券  | 2020-10-16 | 10.00 | 1.00 | A-1 | AAA | 4.1800 |
| 20 然诺 ABN001 次  | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 0.01  | 1.00 |     |     |        |
| 20 海宁城投 CP002   | 短期融资券  | 2020-10-16 | 7.00  | 1.00 | A-1 | AA+ | 3.3400 |
| 20 通盛 B         | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 0.99  | 1.67 | AAA |     |        |
| 长治 03A          | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 8.60  | 2.03 |     |     |        |
| 20 通盛次          | 资产支持证券 | 2020-10-16 | 0.69  | 2.67 |     |     |        |
| 20 大同煤矿 PPN008  | 定向工具   | 2020-10-16 | 10.00 | 3.00 |     | AAA | 5.3000 |
| 20 山煤 MTN003    | 中期票据   | 2020-10-16 | 8.00  | 3.00 | AA+ | AA+ | 6.1500 |
| 20 首创集 MTN002   | 中期票据   | 2020-10-16 | 25.00 | 3.00 | AAA | AAA | 3.7900 |
| 20 浦口康居 MTN004  | 中期票据   | 2020-10-16 | 10.00 | 3.00 | AA+ | AA+ | 4.2400 |
| 20 淮新 05        | 公司债    | 2020-10-16 | 7.00  | 5.00 |     | AA+ | 5.0500 |
| 20 城控 01        | 公司债    | 2020-10-16 | 10.00 | 5.00 | AA+ | AA+ | 4.3000 |
| 金诺转债            | 可转债    | 2020-10-16 | 3.68  | 6.00 | AA- | AA- | 0.4000 |
| 恒逸转债            | 可转债    | 2020-10-16 | 20.00 | 6.00 | AA+ | AA+ | 0.2000 |
| 20 宿控 01        | 公司债    | 2020-10-16 | 5.00  | 7.00 | AAA | AA  | 4.9500 |
| 20 岳阳城投 SCP003  | 短期融资券  | 2020-10-16 | 6.00  | 0.74 |     | AA+ | 3.3000 |
| 20 邮政 SCP007    | 短期融资券  | 2020-10-16 | 30.00 | 0.48 |     | AAA | 2.6500 |
| 20 进出 09(增 10)  | 金融债    | 2020-10-16 | 70.00 | 1.00 |     |     | 2.5300 |
| 19 进出 08(增 18)  | 金融债    | 2020-10-16 | 30.00 | 3.00 |     |     | 3.2300 |
| 20 上海大唐 SCP005  | 短期融资券  | 2020-10-16 | 4.00  | 0.49 |     | AA+ | 3.8500 |
| 20 中电投 SCP026   | 短期融资券  | 2020-10-16 | 24.00 | 0.36 |     | AAA | 2.4000 |
| 20 武进经发 SCP003  | 短期融资券  | 2020-10-16 | 10.00 | 0.25 |     | AA+ | 3.2000 |
| 20 南京地铁 SCP009  | 短期融资券  | 2020-10-16 | 10.00 | 0.74 |     | AAA | 2.9900 |
| 20 粤广业 SCP005   | 短期融资券  | 2020-10-16 | 5.00  | 0.49 |     | AAA | 2.5000 |
| 20 浦口康居 MTN003  | 中期票据   | 2020-10-16 | 5.00  | 3.00 | AA+ | AA+ | 4.2800 |
| 20 晋能 SCP002    | 短期融资券  | 2020-10-16 | 15.00 | 0.74 |     | AAA | 3.7700 |
| 20 天成租赁 GN003   | 中期票据   | 2020-10-16 | 10.00 | 3.00 | AAA | AAA | 4.1200 |
| 20 京煤 MTN001    | 中期票据   | 2020-10-16 | 10.00 | 3.00 | AAA | AA  | 3.9500 |
| 20 九龙江 MTN004   | 中期票据   | 2020-10-16 | 11.00 | 5.00 | AAA | AAA | 4.4000 |
| 20 大唐租赁 SCP004  | 短期融资券  | 2020-10-16 | 8.00  | 0.16 |     | AAA | 3.2700 |
| 20 鄂交 Y2        | 公司债    | 2020-10-16 | 15.00 | 3.00 | AAA | AAA | 4.5000 |

# 附录

|                 |        |            |       |      |     |     |        |
|-----------------|--------|------------|-------|------|-----|-----|--------|
| 20 巨化 01        | 公司债    | 2020-10-16 | 10.00 | 3.00 | AA+ | AA+ | 4.0500 |
| 20 宜宾国资 04      | 企业债    | 2020-10-16 | 18.00 | 5.00 | AAA | AAA | 3.7900 |
| 20 湘高速债 02      | 企业债    | 2020-10-16 | 10.00 | 7.00 | AAA | AAA | 4.1700 |
| 20 邯郸城发专项债 02   | 企业债    | 2020-10-16 | 8.00  | 7.00 | AA+ | AA+ | 5.0800 |
| 20 合和 01        | 公司债    | 2020-10-16 | 10.00 | 5.00 | AAA | AAA | 3.7500 |
| 20 深铁 05        | 公司债    | 2020-10-16 | 10.00 | 3.00 | AAA | AAA | 3.7000 |
| 20 财达 01        | 金融债    | 2020-10-16 | 20.00 | 5.00 | AA+ | AA+ | 4.2600 |
| 20 南钢 G1        | 公司债    | 2020-10-16 | 2.00  | 3.00 | AA+ | AA+ | 5.6000 |
| G20 柳控 2        | 公司债    | 2020-10-16 | 5.00  | 5.00 | AA+ | AA+ | 5.8000 |
| 20 安租 S3        | 公司债    | 2020-10-16 | 8.00  | 1.00 | A-1 | AAA | 3.4500 |
| 20 邮政 Y1        | 公司债    | 2020-10-16 | 40.00 | 2.00 | AAA | AAA | 3.9500 |
| 20 邮政 Y2        | 公司债    | 2020-10-16 | 15.00 | 3.00 | AAA | AAA | 4.2500 |
| 20 邮政 Y3        | 公司债    | 2020-10-16 | 5.00  | 5.00 | AAA | AAA | 4.5200 |
| 东借 07B          | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 0.65  |      |     |     |        |
| 兴辰 03 次         | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 0.60  |      |     |     |        |
| 20 广新控股 SCP034  | 短期融资券  | 2020-10-15 | 5.00  | 0.06 |     | AAA | 1.7500 |
| 20 南航股 SCP028   | 短期融资券  | 2020-10-15 | 10.00 | 0.08 |     | AAA | 1.3000 |
| 20 鲁高速股 SCP006  | 短期融资券  | 2020-10-15 | 10.00 | 0.08 |     | AAA | 2.2000 |
| 20 中车 SCP015    | 短期融资券  | 2020-10-15 | 30.00 | 0.08 |     | AAA | 1.9000 |
| 20 中色 SCP019    | 短期融资券  | 2020-10-15 | 6.00  | 0.09 |     | AAA | 2.0500 |
| 20 中铝资本 SCP005  | 短期融资券  | 2020-10-15 | 7.00  | 0.09 |     | AA+ | 2.8800 |
| 20 首旅 SCP032    | 短期融资券  | 2020-10-15 | 20.00 | 0.16 |     | AAA | 2.4500 |
| 20 鲁国资 SCP006   | 短期融资券  | 2020-10-15 | 10.00 | 0.16 |     | AAA | 2.3500 |
| 20 京能源 SCP005   | 短期融资券  | 2020-10-15 | 13.00 | 0.16 |     | AAA | 1.9000 |
| 20 川水电 SCP002   | 短期融资券  | 2020-10-15 | 5.00  | 0.16 |     | AA+ | 2.7000 |
| 20 云城投 SCP017   | 短期融资券  | 2020-10-15 | 10.00 | 0.16 |     | AAA | 5.6000 |
| 20 联合水泥 SCP018  | 短期融资券  | 2020-10-15 | 10.00 | 0.21 |     | AAA | 1.3000 |
| 20 中交一公 SCP009  | 短期融资券  | 2020-10-15 | 20.00 | 0.21 |     | AAA | 1.9000 |
| 20 宝钢 SCP021    | 短期融资券  | 2020-10-15 | 25.00 | 0.25 |     | AAA | 2.0000 |
| 20 申万宏源 CP008BC | 金融债    | 2020-10-15 | 40.00 | 0.25 | A-1 | AAA | 2.8800 |
| 20 远东租赁 SCP010  | 短期融资券  | 2020-10-15 | 10.00 | 0.30 |     | AAA | 2.0500 |
| 20 临港控股 SCP004  | 短期融资券  | 2020-10-15 | 10.00 | 0.40 |     | AAA | 2.4000 |
| 20 中盐 SCP002    | 短期融资券  | 2020-10-15 | 10.00 | 0.49 |     | AAA | 3.3000 |
| 20 吴江经开 SCP003  | 短期融资券  | 2020-10-15 | 3.00  | 0.49 |     | AA+ | 2.1000 |
| 20 苏交通 SCP027   | 短期融资券  | 2020-10-15 | 20.00 | 0.49 |     | AAA | 1.9000 |
| 20 富邦 SCP003    | 短期融资券  | 2020-10-15 | 4.00  | 0.70 |     | AA  | 5.7000 |

## 附录

|                    |        |            |        |      |     |     |         |
|--------------------|--------|------------|--------|------|-----|-----|---------|
| 20 鲁钢铁 SCP008      | 短期融资券  | 2020-10-15 | 10.00  | 0.74 |     | AAA | 3.3500  |
| 20 淮南城投 SCP003     | 短期融资券  | 2020-10-15 | 2.60   | 0.74 |     | AA  | 3.6400  |
| 橙安 1A1             | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 3.00   | 0.92 | AAA |     | 3.8000  |
| 20 鑫信 ABN001       | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 8.28   | 0.96 | AAA |     | 3.7000  |
| 裕智 02B             | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 0.02   | 0.99 |     |     |         |
| 裕智 02A             | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 5.99   | 0.99 | AAA |     |         |
| 兴辰 03A             | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 17.80  | 1.00 | AAA |     |         |
| 兴辰 03C             | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 0.80   | 1.00 | A+  |     |         |
| 兴辰 03B             | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 0.80   | 1.00 | AA+ |     |         |
| 东借 07A2            | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 0.75   | 1.02 | AA+ |     |         |
| 东借 07A1            | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 8.60   | 1.02 | AAA |     |         |
| 20 惠洲 ABN002 优先 A1 | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 7.00   | 1.24 |     |     | 4.2500  |
| 20 惠洲 ABN002 优先 B  | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 0.30   | 1.48 |     |     | 4.4000  |
| 20 惠洲 ABN002 优先 A2 | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 2.00   | 1.48 |     |     | 4.3000  |
| 橙安 1A2             | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 4.00   | 1.92 | AAA |     | 4.1500  |
| 20 番雅 02           | 公司债    | 2020-10-15 | 15.00  | 2.00 | AAA | AA  | 6.2000  |
| 20 魏投 01           | 公司债    | 2020-10-15 | 2.00   | 2.00 | AAA | AA  | 5.6500  |
| 20 惠洲 ABN002 次     | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 0.70   | 2.00 |     |     |         |
| 建花 15A             | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 17.80  | 2.00 |     |     |         |
| 东五 3 优 B           | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 0.45   | 2.02 |     |     |         |
| 东五 3 优 A           | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 8.40   | 2.02 |     |     |         |
| 橙安 1A3             | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 2.85   | 2.92 | AAA |     | 4.5000  |
| 20 湘高速 PPN004      | 定向工具   | 2020-10-15 | 15.00  | 3.00 |     | AAA | 3.9500  |
| 20 宿东 01           | 公司债    | 2020-10-15 | 2.00   | 3.00 | AA+ | AA  | 6.1000  |
| 20 洪山城投 PPN003     | 定向工具   | 2020-10-15 | 5.00   | 3.00 |     | AA  | 4.6000  |
| 20 亭湖 04           | 公司债    | 2020-10-15 | 6.00   | 3.00 |     | AA  | 7.5000  |
| 20 荆楚文化 MTN001     | 中期票据   | 2020-10-15 | 5.00   | 3.00 | AA  | AA  | 5.8800  |
| 20 溧水城建 PPN003     | 定向工具   | 2020-10-15 | 5.00   | 3.00 |     | AA+ | 4.7500  |
| 20 同煤 04           | 公司债    | 2020-10-15 | 10.00  | 3.00 |     | AAA | 5.4700  |
| 20 魏投 02           | 公司债    | 2020-10-15 | 3.00   | 3.00 | AAA | AA  | 6.0000  |
| 20 晋江国资 MTN003     | 中期票据   | 2020-10-15 | 10.00  | 3.00 | AA+ | AA+ | 4.1400  |
| 橙安 1 次             | 资产支持证券 | 2020-10-15 | 0.15   | 3.17 |     |     | 15.0000 |
| 20 九洲 02           | 公司债    | 2020-10-15 | 5.00   | 5.00 |     | AA+ | 4.4000  |
| 20 哈城投 MTN002      | 中期票据   | 2020-10-15 | 6.00   | 5.00 | AA+ | AA+ | 4.7400  |
| 20 嘉定工业 MTN002     | 中期票据   | 2020-10-15 | 4.00   | 5.00 | AA+ | AA+ | 3.8000  |
| 南航转债               | 可转债    | 2020-10-15 | 160.00 | 6.00 | AAA | AAA | 0.2000  |

# 附录

|                |        |            |        |       |     |     |        |
|----------------|--------|------------|--------|-------|-----|-----|--------|
| 弘信转债           | 可转债    | 2020-10-15 | 5.70   | 6.00  | AA- | AA- | 0.4000 |
| 20 惠农 01       | 公司债    | 2020-10-15 | 10.00  | 7.00  | AA+ | AA+ | 6.5000 |
| 20 苏国信 SCP031  | 短期融资券  | 2020-10-15 | 15.00  | 0.49  |     | AAA | 2.0500 |
| 20 进出 13(增 4)  | 金融债    | 2020-10-15 | 40.00  | 3.00  |     |     | 3.3400 |
| 16 进出 03(增 26) | 金融债    | 2020-10-15 | 110.00 | 10.00 |     |     | 3.3300 |
| 20 进出 10(增 27) | 金融债    | 2020-10-15 | 50.00  | 10.00 |     |     | 3.2300 |
| 20 中交建 MTN002  | 中期票据   | 2020-10-15 | 20.00  | 3.00  | AAA | AAA | 4.3400 |
| 20 江铃汽车 MTN001 | 中期票据   | 2020-10-15 | 10.00  | 5.00  | AA+ | AA+ | 4.2800 |
| 20 临空港投 MTN002 | 中期票据   | 2020-10-15 | 15.00  | 5.00  | AA+ | AA+ | 4.2800 |
| 20 北部湾 MTN005  | 中期票据   | 2020-10-15 | 5.00   | 3.00  | AAA | AAA | 5.8000 |
| 20 鲁高速 MTN003  | 中期票据   | 2020-10-15 | 25.00  | 3.00  | AAA | AAA | 4.4100 |
| 20 上海大唐 SCP004 | 短期融资券  | 2020-10-15 | 6.00   | 0.16  |     | AA+ | 3.6900 |
| 20 渤海证券 CP010  | 金融债    | 2020-10-15 | 20.00  | 0.25  | A-1 | AAA | 3.3000 |
| 20 扬子国投债 01    | 企业债    | 2020-10-15 | 4.00   | 10.00 | AAA | AAA | 4.6500 |
| 20 天风 S1       | 金融债    | 2020-10-15 | 20.00  | 1.00  |     | AAA | 3.6500 |
| 20 建材 Y2       | 公司债    | 2020-10-15 | 20.00  | 2.00  | AAA | AAA | 3.9900 |
| 20 光证 S1       | 金融债    | 2020-10-15 | 50.00  | 1.00  | A-1 | AAA | 3.2000 |
| 20 鲁能 01       | 公司债    | 2020-10-15 | 20.40  | 5.00  | AAA | AAA | 3.8500 |
| 20 中金 11       | 金融债    | 2020-10-15 | 25.00  | 3.00  | AAA | AAA | 3.5000 |
| 20 中金 12       | 金融债    | 2020-10-15 | 25.00  | 5.00  | AAA | AAA | 3.7400 |
| 20 铁 Y11       | 公司债    | 2020-10-15 | 20.00  | 2.00  | AAA | AAA | 4.2000 |
| 20 远东八         | 公司债    | 2020-10-15 | 5.00   | 2.00  | AAA | AAA | 3.3500 |
| 20 铁 Y12       | 公司债    | 2020-10-15 | 10.00  | 3.00  | AAA | AAA | 4.4700 |
| 20 远东九         | 公司债    | 2020-10-15 | 25.00  | 4.00  | AAA | AAA | 3.9100 |
| 20 招路 Y2       | 公司债    | 2020-10-15 | 13.00  | 2.00  | AAA | AAA | 4.1300 |
| 20 招路 Y3       | 公司债    | 2020-10-15 | 5.00   | 3.00  | AAA | AAA | 4.4000 |
| 东花 17B         | 资产支持证券 | 2020-10-14 | 2.25   |       |     |     |        |
| 20 神华新能 SCP003 | 短期融资券  | 2020-10-14 | 10.00  | 0.08  |     | AAA | 1.4000 |
| 20 济南城建 SCP002 | 短期融资券  | 2020-10-14 | 10.00  | 0.08  |     | AAA | 1.7500 |
| 20 中铝国工 SCP006 | 短期融资券  | 2020-10-14 | 10.00  | 0.09  |     | AA+ | 2.6000 |
| 20 烟台港 SCP005  | 短期融资券  | 2020-10-14 | 5.00   | 0.11  |     | AA+ | 2.5000 |
| 20 中燃投资 SCP003 | 短期融资券  | 2020-10-14 | 10.00  | 0.16  |     | AAA | 2.1000 |
| 20 银河证券 CP012  | 金融债    | 2020-10-14 | 40.00  | 0.25  | A-1 | AAA | 2.9000 |
| 20 无锡建投 SCP002 | 短期融资券  | 2020-10-14 | 10.00  | 0.25  |     | AAA | 1.7900 |
| 20 平安证券 CP010  | 金融债    | 2020-10-14 | 30.00  | 0.25  | A-1 | AAA | 2.9800 |
| 20 滨湖建设 SCP003 | 短期融资券  | 2020-10-14 | 5.00   | 0.32  |     | AA+ | 2.7000 |

# 附录

|                   |        |            |       |       |     |     |        |
|-------------------|--------|------------|-------|-------|-----|-----|--------|
| 20 平安租赁 SCP006    | 短期融资券  | 2020-10-14 | 12.00 | 0.36  |     | AAA | 2.6000 |
| 20 云投 SCP023      | 短期融资券  | 2020-10-14 | 20.00 | 0.49  |     | AAA | 3.0000 |
| 20 科伦 SCP003      | 短期融资券  | 2020-10-14 | 8.00  | 0.49  |     | AA+ | 3.9000 |
| 20 先行控股 SCP001    | 短期融资券  | 2020-10-14 | 3.00  | 0.49  |     | AA+ | 2.8000 |
| 20 大同煤矿 SCP022    | 短期融资券  | 2020-10-14 | 15.00 | 0.58  |     | AAA | 4.3000 |
| 20 华菱集团 SCP004    | 短期融资券  | 2020-10-14 | 5.00  | 0.74  |     | AAA | 2.9000 |
| 20 苏汇鸿 SCP003     | 短期融资券  | 2020-10-14 | 3.00  | 0.74  |     | AA+ | 3.7000 |
| 20 华融晋商 SCP002    | 短期融资券  | 2020-10-14 | 5.00  | 0.74  |     | AAA | 4.3500 |
| 20 漳泽电力 SCP005    | 短期融资券  | 2020-10-14 | 5.00  | 0.74  |     | AA+ | 4.4500 |
| 20 顺园 ABN002 优先   | 资产支持证券 | 2020-10-14 | 6.39  | 0.87  |     |     | 4.3800 |
| 20 顺园 ABN002 次    | 资产支持证券 | 2020-10-14 | 0.01  | 0.87  |     |     |        |
| 20 溧城 D1          | 公司债    | 2020-10-14 | 10.00 | 1.00  |     | AA+ | 3.8000 |
| 20 融信通达 ABN002 次  | 资产支持证券 | 2020-10-14 | 0.01  | 1.00  |     |     |        |
| 20 融信通达 ABN002 优先 | 资产支持证券 | 2020-10-14 | 3.53  | 1.00  |     |     | 5.8500 |
| 东花 17A1           | 资产支持证券 | 2020-10-14 | 26.70 | 1.36  | AAA |     |        |
| 东花 17A2           | 资产支持证券 | 2020-10-14 | 1.05  | 1.36  | AA+ |     |        |
| 20 中核 MTN001A     | 中期票据   | 2020-10-14 | 20.00 | 2.00  | AAA | AAA | 3.9500 |
| 20 柳州东通 MTN002    | 中期票据   | 2020-10-14 | 5.00  | 3.00  | AA+ | AA  | 6.8000 |
| 20 江阴临港 PPN001    | 定向工具   | 2020-10-14 | 10.00 | 3.00  |     | AA+ | 4.9900 |
| 20 新希望 MTN003     | 中期票据   | 2020-10-14 | 10.00 | 3.00  | AAA | AAA | 4.3800 |
| 20 漳州开发 MTN001    | 中期票据   | 2020-10-14 | 10.00 | 3.00  | AAA | AA  | 3.9000 |
| 20 中核 MTN001B     | 中期票据   | 2020-10-14 | 10.00 | 3.00  | AAA | AAA | 4.2500 |
| 20 长寿开投 PPN001    | 定向工具   | 2020-10-14 | 6.00  | 4.00  |     | AA+ | 6.5000 |
| 20 鄞城 04          | 公司债    | 2020-10-14 | 5.00  | 5.00  |     | AA+ | 4.7500 |
| 20 伊资 02          | 公司债    | 2020-10-14 | 5.50  | 5.00  |     | AA  | 6.4500 |
| 20 川铁投 MTN005     | 中期票据   | 2020-10-14 | 10.00 | 5.00  | AAA | AAA | 3.9200 |
| 20 宜新 02          | 公司债    | 2020-10-14 | 10.00 | 5.00  | AAA | AA  | 4.5000 |
| 20 湘江新发 MTN001    | 中期票据   | 2020-10-14 | 10.00 | 5.00  | AAA | AAA | 3.7000 |
| 20 醴渌 02          | 公司债    | 2020-10-14 | 5.00  | 6.00  | AA  | AA  | 7.5000 |
| 20 武汉地铁 GN001     | 中期票据   | 2020-10-14 | 20.00 | 15.00 | AAA | AAA | 4.1000 |
| 20 滨江房产 MTN003    | 中期票据   | 2020-10-14 | 9.40  | 3.00  | AAA | AAA | 4.4000 |
| 20 晋能 MTN017      | 中期票据   | 2020-10-14 | 5.00  | 3.00  | AAA | AAA | 5.3300 |
| 20 内蒙华电 MTN001    | 中期票据   | 2020-10-14 | 5.00  | 3.00  | AAA | AAA | 4.6800 |
| 20 漳州交运 CP002     | 短期融资券  | 2020-10-14 | 10.00 | 1.00  | A-1 | AA+ | 3.3800 |
| 20 运城城投 SCP002    | 短期融资券  | 2020-10-14 | 5.00  | 0.74  |     | AA  | 3.9900 |
| 20 义乌国资 MTN005    | 中期票据   | 2020-10-14 | 5.00  | 3.00  | AA+ | AA+ | 5.2900 |

# 附录

|                      |        |            |       |       |     |     |        |
|----------------------|--------|------------|-------|-------|-----|-----|--------|
| 20 中原资产 SCP002       | 短期融资券  | 2020-10-14 | 7.00  | 0.49  |     | AAA | 3.6000 |
| 20 恒逸 CP004          | 短期融资券  | 2020-10-14 | 7.00  | 1.00  | A-1 | AA+ | 6.5000 |
| 20 新海连 MTN002        | 中期票据   | 2020-10-14 | 6.00  | 3.00  | AA+ | AA+ | 4.7500 |
| 20 甘公投 MTN004        | 中期票据   | 2020-10-14 | 10.00 | 5.00  | AAA | AAA | 4.4800 |
| 唐新 Y12               | 公司债    | 2020-10-14 | 10.00 | 1.00  | AAA | AAA | 3.6900 |
| 20 农发 06(增 14)       | 金融债    | 2020-10-14 | 23.30 | 1.00  |     |     | 2.1100 |
| 18 农发 13(增 16)       | 金融债    | 2020-10-14 | 47.60 | 5.00  |     |     | 3.5500 |
| 20 农发 04(增 25)       | 金融债    | 2020-10-14 | 95.30 | 10.00 |     |     | 2.9600 |
| 16 农发 05(增 24)       | 金融债    | 2020-10-14 | 29.20 | 10.00 |     |     | 3.3300 |
| 20 能建 Y2             | 公司债    | 2020-10-14 | 35.00 | 1.00  | AAA | AAA | 3.6700 |
| 20 青城 01             | 公司债    | 2020-10-14 | 5.00  | 6.00  | AAA | AAA | 3.8000 |
| 20 青城 02             | 公司债    | 2020-10-14 | 10.00 | 8.00  | AAA | AAA | 4.2000 |
| 20 闽能 Y1             | 公司债    | 2020-10-14 | 12.00 | 2.00  | AAA | AAA | 4.1000 |
| 20 电建 Y2             | 公司债    | 2020-10-14 | 20.00 | 3.00  | AAA | AAA | 4.4300 |
| 20 上实 A1             | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 10.70 |       | AAA |     | 5.8000 |
| 20 上实 A2             | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 3.96  |       | AAA |     | 6.2000 |
| 20 上实次               | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 1.95  |       |     |     |        |
| 20 上实 B              | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 1.39  |       | AA+ |     | 7.0000 |
| 至合 4 次               | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 0.70  |       |     |     |        |
| 20 中电信 SCP012        | 短期融资券  | 2020-10-13 | 30.00 | 0.08  |     | AAA | 1.2000 |
| 20 北部湾 SCP007        | 短期融资券  | 2020-10-13 | 5.00  | 0.08  |     | AAA | 2.2000 |
| 20 沪电力 SCP018        | 短期融资券  | 2020-10-13 | 17.00 | 0.08  |     | AAA | 1.5500 |
| 20 广新控股 SCP033       | 短期融资券  | 2020-10-13 | 5.00  | 0.08  |     | AAA | 1.8300 |
| 20 渝医药 SCP005        | 短期融资券  | 2020-10-13 | 4.00  | 0.16  |     | AA+ | 2.2000 |
| 20 平安租赁 ABN002 优先 A1 | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 4.00  | 0.20  |     |     | 3.9000 |
| 20 财通证券 CP010        | 金融债    | 2020-10-13 | 25.00 | 0.25  | A-1 | AAA | 3.0900 |
| 20 国泰君安 CP010        | 金融债    | 2020-10-13 | 50.00 | 0.25  | A-1 | AAA | 2.6900 |
| 20 海通证券 CP008        | 金融债    | 2020-10-13 | 50.00 | 0.25  | A-1 | AAA | 2.8800 |
| 20 国信证券 CP012        | 金融债    | 2020-10-13 | 30.00 | 0.25  | A-1 | AAA | 2.8000 |
| 20 国金证券 CP009        | 金融债    | 2020-10-13 | 10.00 | 0.25  | A-1 | AAA | 3.0000 |
| 20 沪国资 SCP001        | 短期融资券  | 2020-10-13 | 15.00 | 0.49  |     | AAA | 1.6000 |
| 20 红狮 SCP007         | 短期融资券  | 2020-10-13 | 8.00  | 0.69  |     | AAA | 3.5500 |
| 20 华电租赁 SCP004       | 短期融资券  | 2020-10-13 | 5.00  | 0.73  |     | AAA | 2.6000 |
| 20 景德陶瓷 SCP001       | 短期融资券  | 2020-10-13 | 5.00  | 0.74  |     | AA  | 4.1000 |
| 20 合川城投 SCP003       | 短期融资券  | 2020-10-13 | 5.00  | 0.74  |     | AA+ | 3.6600 |

## 附录

|                      |        |            |       |      |     |     |        |
|----------------------|--------|------------|-------|------|-----|-----|--------|
| 至合 4A1               | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 6.00  | 0.82 | AAA |     |        |
| 链融 32A1              | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 4.90  | 0.94 | AAA |     |        |
| 蛇口 11 优              | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 5.05  | 1.00 | AAA |     | 3.5500 |
| 20 锡产业 CP002         | 短期融资券  | 2020-10-13 | 10.00 | 1.00 | A-1 | AAA | 3.3000 |
| 20 中天建设 CP001        | 短期融资券  | 2020-10-13 | 5.00  | 1.00 | A-1 | AA+ | 4.8000 |
| 20 晋能 CP008          | 短期融资券  | 2020-10-13 | 10.00 | 1.00 | A-1 | AAA | 3.9800 |
| 20 泰城 D1             | 公司债    | 2020-10-13 | 10.00 | 1.00 |     | AA+ | 3.7500 |
| 20 潍坊滨投 CP001        | 短期融资券  | 2020-10-13 | 5.00  | 1.00 | A-1 | AA+ | 4.2800 |
| 20 溧水产投 CP001        | 短期融资券  | 2020-10-13 | 7.00  | 1.00 | A-1 | AA  | 4.1000 |
| 中借 05C               | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 0.98  | 1.03 |     |     |        |
| 中借 05A               | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 12.90 | 1.03 | AAA |     | 4.1000 |
| 中借 05B               | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 1.13  | 1.03 | AA+ |     |        |
| 20 平安租赁 ABN002 优先 A2 | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 2.38  | 1.20 |     |     | 4.4900 |
| 至合 4B                | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 0.30  | 1.24 | AA+ |     |        |
| 至合 4A2               | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 3.00  | 1.24 | AAA |     |        |
| 20 平安租赁 ABN002 优先 B  | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 0.55  | 1.70 |     |     | 5.7000 |
| 20 飞驰未来 ABN001 优先    | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 4.99  | 2.00 |     |     | 4.7000 |
| 20 飞驰未来 ABN001 次     | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 0.01  | 2.00 |     |     |        |
| 20 国联 04             | 金融债    | 2020-10-13 | 10.00 | 2.00 | AA+ | AA+ | 4.0700 |
| 20 平安租赁 ABN002 次     | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 0.66  | 2.19 |     |     |        |
| 20 链智 ABN001A1       | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 1.90  | 2.76 |     |     | 4.0000 |
| 20 昌发 01             | 公司债    | 2020-10-13 | 2.00  | 3.00 |     | AA  | 4.3000 |
| 20 江北新区 PPN003       | 定向工具   | 2020-10-13 | 8.00  | 3.00 |     | AAA | 4.2100 |
| 20 晋产 01             | 公司债    | 2020-10-13 | 5.00  | 3.00 |     | AA  | 4.8500 |
| 20 链智 ABN001A2       | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 0.41  | 3.01 |     |     | 4.7000 |
| 20 芜湖建设 MTN004       | 中期票据   | 2020-10-13 | 4.00  | 5.00 | AA+ | AA+ | 3.9800 |
| 20 惠民城建 PPN004       | 定向工具   | 2020-10-13 | 5.00  | 5.00 |     | AA+ | 6.9000 |
| 20 即墨旅投 MTN001       | 中期票据   | 2020-10-13 | 6.00  | 5.00 | AA+ | AA+ | 4.0500 |
| 20 江阴高新 MTN002       | 中期票据   | 2020-10-13 | 1.00  | 5.00 | AA  | AA  | 4.6500 |
| 20 闽投 MTN006         | 中期票据   | 2020-10-13 | 10.00 | 5.00 | AAA | AAA | 4.1000 |
| 20 建发地产 PPN004       | 定向工具   | 2020-10-13 | 3.00  | 5.00 |     | AAA | 4.7000 |
| 20 广州高新 PPN001       | 定向工具   | 2020-10-13 | 10.00 | 5.00 |     | AA+ | 4.2800 |
| 20 江阴高新 MTN001       | 中期票据   | 2020-10-13 | 1.00  | 5.00 | AA  | AA  | 4.6500 |
| 20 常熟发投 PPN002       | 定向工具   | 2020-10-13 | 8.20  | 5.00 |     | AA+ | 4.2800 |
| 20 南昌金开 PPN001B      | 定向工具   | 2020-10-13 | 1.00  | 5.00 |     |     | 6.0000 |

# 附录

|                   |        |            |        |       |     |     |        |
|-------------------|--------|------------|--------|-------|-----|-----|--------|
| 20 南昌金开 PPN001A   | 定向工具   | 2020-10-13 | 2.00   | 5.00  |     |     | 6.0000 |
| 20 广丰 01          | 公司债    | 2020-10-13 | 20.00  | 5.00  | AAA | AA  | 6.0000 |
| 20 景德城投 PPN003    | 定向工具   | 2020-10-13 | 2.00   | 5.00  |     | AA  | 5.6300 |
| 多伦转债              | 可转债    | 2020-10-13 | 6.40   | 6.00  | AA- | AA- | 0.4000 |
| 20 汇聚通 2A1_bc     | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 20.00  | 0.95  | AAA |     | 3.0500 |
| 20 汇聚通 2A2_bc     | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 15.50  | 1.36  | AAA |     | 3.1100 |
| 20 汇聚通 2B_bc      | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 2.50   | 1.69  | AA+ |     | 3.9700 |
| 20 汇聚通 2C_bc      | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 2.00   | 4.37  |     |     |        |
| 20 鸿富 1 优先        | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 0.60   | 1.27  | AAA |     | 3.2900 |
| 20 鸿富 1C          | 资产支持证券 | 2020-10-13 | 0.18   | 2.77  |     |     |        |
| 20 兴业银行永续债        | 金融债    | 2020-10-13 | 300.00 | 5.00  | AAA | AAA | 4.7300 |
| 20 国开 07(增 8)     | 金融债    | 2020-10-13 | 77.00  | 3.00  |     |     | 3.0000 |
| 20 国开 12(增 12)    | 金融债    | 2020-10-13 | 101.00 | 5.00  |     |     | 3.3400 |
| 20 国开 09(增 12)    | 金融债    | 2020-10-13 | 41.00  | 7.00  |     |     | 3.3900 |
| 20 国开 20(增 8)     | 金融债    | 2020-10-13 | 25.00  | 20.00 |     |     | 3.9000 |
| 20 海尔金控 SCP003    | 短期融资券  | 2020-10-13 | 8.00   | 0.49  |     | AAA | 2.7000 |
| 20 中航租赁 SCP010    | 短期融资券  | 2020-10-13 | 10.00  | 0.40  |     | AAA | 2.5000 |
| 20 河钢集 MTN012     | 中期票据   | 2020-10-13 | 20.00  | 3.00  | AAA | AAA | 4.0000 |
| 20 汉江国资 MTN003    | 中期票据   | 2020-10-13 | 10.00  | 3.00  | AAA | AAA | 3.9200 |
| 20 中电投 MTN014     | 中期票据   | 2020-10-13 | 20.00  | 3.00  | AAA | AAA | 4.3500 |
| 20 鲁西化工 SCP008    | 短期融资券  | 2020-10-13 | 10.00  | 0.16  |     | AAA | 3.1500 |
| 20 大唐租赁 MTN001    | 中期票据   | 2020-10-13 | 10.00  | 2.00  | AAA | AAA | 4.9000 |
| 20 豫交运 MTN006     | 中期票据   | 2020-10-13 | 15.00  | 3.00  | AAA | AAA | 3.8400 |
| 20 陕煤化 SCP002     | 短期融资券  | 2020-10-13 | 30.00  | 0.49  |     | AAA | 2.9900 |
| 20ST002           | 公司债    | 2020-10-13 | 5.00   | 3.00  | AA+ | AA+ | 4.3000 |
| 20 京电 01          | 公司债    | 2020-10-13 | 8.00   | 3.00  | AAA | AAA | 3.7500 |
| 20 首钢 04          | 公司债    | 2020-10-13 | 25.00  | 6.00  | AAA | AAA | 3.8700 |
| 20 东北证券 CP007     | 金融债    | 2020-10-13 | 15.00  | 0.25  | A-1 | AAA | 3.1000 |
| 20 农发清发 03(增发 3)  | 金融债    | 2020-10-13 | 26.60  | 2.00  |     |     | 3.2500 |
| 20 农发清发 02(增发 19) | 金融债    | 2020-10-13 | 30.80  | 7.00  |     |     | 2.8700 |
| 20 山东高速债 01       | 企业债    | 2020-10-13 | 20.00  | 3.00  | AAA | AAA | 3.8000 |
| 20 南京地铁绿色债 02     | 企业债    | 2020-10-13 | 20.00  | 6.00  | AAA | AAA | 3.7900 |
| 20 宁国债            | 企业债    | 2020-10-13 | 7.90   | 7.00  | AAA | AA  | 4.8900 |
| 20 津投 19          | 公司债    | 2020-10-13 | 10.00  | 6.00  | AAA | AAA | 4.2200 |
| 20 恒大 05          | 公司债    | 2020-10-13 | 21.00  | 5.00  | AAA | AAA | 5.8000 |
| 20 财信 01          | 公司债    | 2020-10-13 | 20.00  | 5.00  | AAA | AAA | 3.9700 |

## 附录

|               |     |            |          |      |     |     |        |
|---------------|-----|------------|----------|------|-----|-----|--------|
| 20 葛洲 Y2      | 公司债 | 2020-10-13 | 30.00    | 2.00 | AAA | AAA | 4.1400 |
| 20 建集 Y7      | 公司债 | 2020-10-13 | 13.00    | 3.00 | AAA | AAA | 4.7000 |
| 20 义乌 05      | 公司债 | 2020-10-13 | 10.00    | 3.00 | AA+ | AA+ | 4.1500 |
| 20 华西证券 CP008 | 金融债 | 2020-10-13 | 10.00    | 0.25 | A-1 | AAA | 3.0000 |
|               |     | 合计         | 4,936.89 |      |     |     |        |

数据来源：wind，西部担保整理



## 西部（银川）担保有限公司

---

地址：宁夏银川市金凤区上海西路239号英力特大厦B座18层  
网址：<http://www.xibudanbao.com> / 电话：0951-7835555

### 联系方式：

李彦龙（大客户部总经理）  
0951-7695636

王栋（大客户部副总经理）  
0951-7659766

李庆玲（大客户部总经理助理）  
0951-7659766