

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
主权债																							
3	N	XS0971721377	RUSSIAN FEDERATION	俄罗斯 外国债券	RUSSIA 3 1/2 01/16/19	USD	100.269	2.611	2.611	2.611	0.311	Ba1	BBB-	BBB-	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	16/01/2019	200,000	200,000	1,500,000,000
3	N	XS0504954347	RUSSIAN FEDERATION	俄罗斯 外国债券	RUSSIA 5 04/29/20	USD	102.037	3.673	3.673	3.673	1.526	Ba1	BBB-	BBB-	5	FIXED	N	N/A	N/A	29/04/2020	100,000	100,000	3,500,000,000
3	N	XS0767472458	RUSSIAN FEDERATION	俄罗斯 外国债券	RUSSIA 4 1/2 04/04/22	USD	100.971	4.201	4.201	4.201	3.235	Ba1	BBB-	BBB-	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	4/04/2022	200,000	200,000	2,000,000,000
4	N	XS0971721450	RUSSIAN FEDERATION	俄罗斯 外国债券	RUSSIA 4 7/8 09/16/23	USD	102.180	4.383	4.383	4.383	4.482	Ba1	BBB-	BBB-	4.875	FIXED	N	N/A	N/A	16/09/2023	200,000	200,000	3,000,000,000
5	N	XS0767473852	RUSSIAN FEDERATION	俄罗斯 外国债券	RUSSIA 5 5/8 04/04/42	USD	102.622	5.426	5.426	5.426	13.118	Ba1	BBB-	BBB-	5.625	FIXED	N	N/A	N/A	4/04/2042	200,000	200,000	3,000,000,000
5	N	XS0971721963	RUSSIAN FEDERATION	俄罗斯 外国债券	RUSSIA 5 7/8 09/16/43	USD	105.746	5.451	5.451	5.451	13.698	Ba1	BBB-	BBB-	5.875	FIXED	N	N/A	N/A	16/09/2043	200,000	200,000	1,500,000,000
5	N	US105756BB58	FED REPUBLIC OF BRAZIL	巴西政府 国际债券	BRAZIL 8 1/4 01/20/34	USD	114.310	6.737	6.737	6.737	9.275	Ba2	BB-	BB-	8.25	FIXED	N	N/A	N/A	20/01/2034	1,000	1,000	1,502,458,000
4	N	US105756BU30	FED REPUBLIC OF BRAZIL	巴西政府 国际债券	BRAZIL 2 5/8 01/05/23	USD	90.655	5.081	5.081	5.081	4.039	Ba2	BB-	BB-	2.625	FIXED	N	N/A	N/A	5/01/2023	200,000	1,000	2,150,000,000
4	N	US105756BS83	FED REPUBLIC OF BRAZIL	巴西政府 国际债券	BRAZIL 4 7/8 01/22/21	USD	101.015	4.409	4.409	4.409	2.212	Ba2	BB-	BB-	4.875	FIXED	N	N/A	N/A	22/01/2021	100,000	1,000	2,713,192,000
5	N	US105756BR01	FED REPUBLIC OF BRAZIL	巴西政府 国际债券	BRAZIL 5 5/8 01/07/41	USD	86.545	6.806	6.806	6.806	12.084	Ba2	BB-	BB-	5.625	FIXED	N	N/A	N/A	7/01/2041	100,000	1,000	2,484,311,000
5	N	US105756BK57	FED REPUBLIC OF BRAZIL	巴西政府 国际债券	BRAZIL 7 1/8 01/20/37	USD	104.905	6.656	6.656	6.656	10.571	Ba2	BB-	BB-	7.125	FIXED	N	N/A	N/A	20/01/2037	1,000	1,000	1,920,418,000
4	N	US105756BV13	FED REPUBLIC OF BRAZIL	巴西政府 国际债券	BRAZIL 4 1/4 01/07/25	USD	93.365	5.512	5.512	5.512	5.500	Ba2	BB-	BB-	4.25	FIXED	N	N/A	N/A	7/01/2025	200,000	1,000	4,300,000,000
4	N	US105756BX78	FED REPUBLIC OF BRAZIL	巴西政府 国际债券	BRAZIL 6 04/07/26	USD	100.405	5.932	5.932	5.932	6.009	Ba2	BB-	BB-	6	FIXED	N	N/A	N/A	7/04/2026	200,000	1,000	2,176,245,000
5	N	US105756BW95	FED REPUBLIC OF BRAZIL	巴西政府 国际债券	BRAZIL 5 01/27/45	USD	78.390	6.768	6.768	6.768	13.290	Ba2	BB-	BB-	5	FIXED	N	N/A	N/A	27/01/2045	200,000	1,000	3,550,000,000
5	N	US105756BY51	FED REPUBLIC OF BRAZIL	巴西政府 国际债券	BRAZIL 5 5/8 02/21/47	USD	84.200	6.900	6.900	6.900	13.230	Ba2	BB-	BB-	5.625	FIXED	N	N/A	N/A	21/02/2047	200,000	1,000	3,000,000,000
5	N	USY20721AE96	REPUBLIC OF INDONESIA	印度尼西亚政府 国际债券	INDON 8 1/2 10/12/35	USD	135.842	5.284	5.284	5.284	10.125	Baa2	BBB-	WD	8.5	FIXED	N	N/A	N/A	12/10/2035	100,000	1,000	1,600,000,000
5	N	USY20721BE87	REPUBLIC OF INDONESIA	印度尼西亚政府 国际债券	INDON 4 5/8 04/15/43	USD	93.098	5.122	5.122	5.122	14.240	Baa2	BBB-	BBB	4.625	FIXED	N	N/A	N/A	15/04/2043	200,000	1,000	1,500,000,000
4	N	USY20721BN86	REPUBLIC OF INDONESIA	印度尼西亚政府 国际债券	INDON 4 3/4 01/08/26	USD	101.248	4.546	4.546	4.546	6.194	Baa2	BBB-	BBB	4.75	FIXED	N	N/A	N/A	8/01/2026	200,000	1,000	2,250,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
4	N	US718286AP29	REPUBLIC OF PHILIPPINES	菲律宾 国际债券	PHILIP 10 5/8 03/16/25	USD	139.127	3.762	3.762	3.762	5.112	Baa2	BBB	BBB	10.625	FIXED	N	N/A	N/A	16/03/2025	1,000	1,000	1,480,193,000
4	N	US718286BN61	REPUBLIC OF PHILIPPINES	菲律宾 国际债券	PHILIP 5 1/2 03/30/26	USD	111.009	3.802	3.802	3.802	6.185	Baa2	BBB	BBB	5.5	FIXED	N	N/A	N/A	30/03/2026	200,000	1,000	1,032,178,000
5	N	US718286AY36	REPUBLIC OF PHILIPPINES	菲律宾 国际债券	PHILIP 9 1/2 02/02/30	USD	148.019	4.152	4.152	4.152	7.903	Baa2	BBB	BBB	9.5	FIXED	N	N/A	N/A	2/02/2030	2,000	1,000	2,000,000,000
5	N	US718286BB24	REPUBLIC OF PHILIPPINES	菲律宾 国际债券	PHILIP 7 3/4 01/14/31	USD	135.074	4.093	4.093	4.093	8.683	Baa2	BBB	BBB	7.75	FIXED	N	N/A	N/A	14/01/2031	100,000	1,000	1,744,446,000
5	N	US718286BD89	REPUBLIC OF PHILIPPINES	菲律宾 国际债券	PHILIP 6 3/8 01/15/32	USD	122.662	4.142	4.142	4.142	9.520	Baa2	BBB	BBB	6.375	FIXED	N	N/A	N/A	15/01/2032	100,000	1,000	1,022,248,000
5	N	US718286BG11	REPUBLIC OF PHILIPPINES	菲律宾 国际债券	PHILIP 6 3/8 10/23/34	USD	125.046	4.214	4.214	4.214	10.721	Baa2	BBB	BBB	6.375	FIXED	N	N/A	N/A	23/10/2034	100,000	1,000	1,900,131,000
5	N	US718286BW60	REPUBLIC OF PHILIPPINES	菲律宾 国际债券	PHILIP 5 01/13/37	USD	109.629	4.238	4.238	4.238	12.392	Baa2	BBB	BBB	5	FIXED	N	N/A	N/A	13/01/2037	200,000	1,000	1,330,799,000
5	N	US718286BZ91	REPUBLIC OF PHILIPPINES	菲律宾 国际债券	PHILIP 3.95 01/20/40	USD	96.971	4.165	4.165	4.165	14.385	Baa2	BBB	BBB	3.95	FIXED	N	N/A	N/A	20/01/2040	200,000	1,000	2,000,000,000
5	N	US718286CA32	REPUBLIC OF PHILIPPINES	菲律宾 国际债券	PHILIP 3.7 03/01/41	USD	93.414	4.154	4.154	4.154	15.122	Baa2	BBB	BBB	3.7	FIXED	N	N/A	N/A	1/03/2041	200,000	1,000	2,000,000,000
5	N	US718286CB15	REPUBLIC OF PHILIPPINES	菲律宾 国际债券	PHILIP 3.7 02/02/42	USD	93.199	4.158	4.158	4.158	15.445	Baa2	BBB	BBB	3.7	FIXED	N	N/A	N/A	2/02/2042	200,000	1,000	2,000,000,000
4	Y	USP04808AL87	REPUBLIC OF ARGENTINA	阿根廷 国际债券	ARGENT 5 5/8 01/26/22	USD	90.540	8.961	8.961	8.961	3.047	B2	B+ *	N/A	5.625	FIXED	N	N/A	N/A	26/01/2022	1,000	1,000	70,000
4	Y	USP04808AM60	REPUBLIC OF ARGENTINA	阿根廷 国际债券	ARGENT 6 7/8 01/26/27	USD	107.250	5.766	5.766	5.766	6.492	B2	B+ *	N/A	6.875	FIXED	N	N/A	N/A	26/01/2027	1,000	1,000	165,000
4	N	US50064FAM68	REPUBLIC OF KOREA	阿根廷 国际债券	KOREA 2 3/4 01/19/27	USD	93.896	3.605	3.605	3.605	7.422	Aa2	AA	AA-	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	19/01/2027	200,000	1,000	1,000,000,000
高收益债券																							
内地房地产类																							
4	N	XS1164776020	COUNTRY GARDEN HLDG CO	碧桂园	COGARD 7 1/2 03/09/20	USD	102.024	6.026	29.014	6.026	1.405	Ba2	BB	BBB-	7.5	FIXED	Y	22/10/2018	103.750	9/03/2020	200,000	1,000	900,000,000
4	N	USG24524AH67	COUNTRY GARDEN HLDGS	碧桂园	COGARD 7 1/4 04/04/21	USD	100.691	6.946	22.268	6.541	0.976	Ba2	BB	N/A	7.25	FIXED	Y	22/10/2018	101.813	4/04/2021	200,000	1,000	750,000,000
4	Y	XS1512953040	COUNTRY GARDEN HLDGS	碧桂园	COGARD 5 5/8 12/15/26	USD	96.022	6.249	6.249	7.021	2.943	Ba2	N/A	BBB-	5.625	FIXED	N	N/A	N/A	15/12/2026	200,000	1,000	350,000,000
4	Y	XS1545743442	EASY TACTIC LTD	富力地产	GZRFPR 5 3/4 01/13/22	USD	90.290	9.222	16.371	9.222	3.004	N/A	N/A	BB-	5.75	FIXED	Y	13/01/2020	102.875	13/01/2022	200,000	1,000	725,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增额	流通额
4	Y	XS1014156274	KWG GROUP HOLDINGS	合景泰富	KWGPRO 8.975 01/14/19	USD	101.166	5.013	22.186	5.037	0.306	B2	B	N/A	8.975	FIXED	Y	22/10/2018	102.244	14/01/2019	200,000	1,000	600,000,000
4	Y	XS1545506401	KWG GROUP HOLDINGS	合景泰富	KWGPRO 6 01/11/22	USD	92.505	8.656	14.717	8.656	2.991	N/A	B	BB-	6	FIXED	Y	11/01/2020	103.000	11/01/2022	200,000	1,000	250,000,000
4	Y	XS1556169206	KWG GROUP HOLDINGS	合景泰富	KWGPRO 6 09/15/22	USD	90.418	8.915	15.392	8.915	3.566	N/A	B	BB-	6	FIXED	Y	15/03/2020	103.000	15/09/2022	200,000	1,000	650,000,000
4	Y	XS1580430681	CHINA EVERGRANDE GROUP	恒大地产	EVERRE 7 03/23/20	USD	100.320	6.771	6.771	6.771	1.447	B2	N/A	B-	7	FIXED	N	N/A	N/A	23/03/2020	200,000	1,000	500,000,000
4	N	XS1627599142	CHINA EVERGRANDE GROUP	恒大地产	EVERRE 6 1/4 06/28/21	USD	96.352	7.737	7.737	7.737	2.538	B2	B	B-	6.25	FIXED	N	N/A	N/A	28/06/2021	200,000	1,000	598,181,000
4	Y	XS1580431143	CHINA EVERGRANDE GROUP	恒大地产	EVERRE 8 1/4 03/23/22	USD	98.177	8.867	12.212	8.867	3.103	B2	N/A	B-	8.25	FIXED	Y	23/03/2020	104.125	23/03/2022	200,000	1,000	1,000,000,000
4	N	XS1627599498	CHINA EVERGRANDE GROUP	恒大地产	EVERRE 7 1/2 06/28/23	USD	91.076	9.889	15.387	9.889	3.978	B2	B	B-	7.5	FIXED	Y	28/06/2020	103.750	28/06/2023	200,000	1,000	1,344,921,000
4	N	XS1587867539	CHINA EVERGRANDE GROUP	恒大地产	EVERRE 9 1/2 03/29/24	USD	95.489	10.600	13.321	10.600	4.185	B2	N/A	B-	9.5	FIXED	Y	29/03/2021	104.750	29/03/2024	200,000	1,000	1,000,000,000
4	N	XS1627599654	CHINA EVERGRANDE GROUP	恒大地产	EVERRE 8 3/4 06/28/25	USD	89.470	10.991	14.859	10.991	5.030	B2	B	B-	8.75	FIXED	Y	28/06/2021	104.375	28/06/2025	200,000	1,000	4,680,476,000
4	Y	XS1215617272	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	雅居乐	AGILE 9 05/21/20	USD	104.723	5.958	5.689	5.003	0.638	Ba3	BB	N/A	9	FIXED	Y	22/10/2018	104.500	21/05/2020	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	XS0872777122	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	雅居乐	AGILE 10.215 PERP	USD	101.175	10.221	6.312	6.312	0.317	N/A	N/A	N/A	10.215	VARIABLE	Y	18/01/2019	100.000	永续债	200,000	1,000	700,000,000
4	N	XS0879582301	CENTRAL CHN REAL ESTATE	建业地产	CENCHI 8 01/28/20	USD	100.717	7.417	24.024	5.805	0.344	B1	B+	N/A	8	FIXED	Y	22/10/2018	102.000	28/01/2020	200,000	1,000	200,000,000
4	N	XS1219965297	CENTRAL CHINA REAL ESTAT	建业地产	CENCHI 8 3/4 01/23/21	USD	101.742	7.908	16.193	7.908	2.132	B1	B+	N/A	8.75	FIXED	Y	23/01/2019	104.375	23/01/2021	200,000	1,000	300,000,000
4	N	XS1144941439	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	融创中国	SUNAC 8 3/4 12/05/19	USD	102.161	6.824	35.508	6.824	1.136	B3	B	BB-	8.75	FIXED	Y	22/10/2018	104.375	5/12/2019	200,000	1,000	400,000,000
4	Y	XS1272206209	GREENTOWN CHINA HLDGS	绿城中国	GRNCH 5 7/8 08/11/20	USD	100.037	5.850	42.857	5.850	1.797	Ba3	B+	N/A	5.875	FIXED	Y	22/10/2018	102.938	11/08/2020	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	XS1160444391	CIFI HOLDINGS GROUP	旭辉控股	CIFIHG 7 3/4 06/05/20	USD	101.440	6.827	37.632	6.827	1.589	B1	B+	BB	7.75	FIXED	Y	22/10/2018	103.875	5/06/2020	200,000	1,000	400,000,000
4	Y	XS1513700127	CIFI HOLDINGS GROUP	旭辉控股	CIFIHG 5 1/2 01/23/22	USD	92.996	7.930	13.359	7.930	3.049	N/A	B+	N/A	5.5	FIXED	Y	23/01/2020	102.750	23/01/2022	200,000	1,000	285,000,000
4	N	XS1565437057	FUTURE LAND DEVELOPMEN T	新城发展控股	FUTLAN 5 02/16/20	USD	97.513	6.896	6.896	6.896	1.358	N/A	BB-	BB	5	FIXED	N	N/A	N/A	16/02/2020	200,000	1,000	350,000,000
4	Y	XS1464929329	RKI OVERSEAS FIN 2016 A	路劲基建	ROADKG 5 08/09/19	USD	100.096	4.880	4.880	4.880	0.863	B1	BB-	N/A	5	FIXED	N	N/A	N/A	9/08/2019	200,000	1,000	450,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增额	流通额
4	Y	XS1483944317	RKI OVERSEAS FIN 2016 B	路劲基建	ROADKG 4.7 09/06/21	USD	95.264	6.489	12.541	6.489	2.778	B1	BB-	N/A	4.7	FIXED	Y	6/09/2019	102.350	6/09/2021	200,000	1,000	500,000,000
5	N	XS1567389728	RKP OVERSEAS FI 2016 A	路劲基建	ROADKG 7.95 PERP	USD	85.193	9.330	13.521	9.330	11.115	B1	N/A	N/A	7.95	FIXED	Y	17/02/2022	100.000	永续债	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	XS1342837264	LOGAN PROPERTY HOLDINGS	龙光地产	LOGPH 7.7 01/19/20	USD	101.189	6.731	13.033	6.731	1.265	B1	N/A	BB-	7.7	FIXED	Y	19/01/2019	103.000	19/01/2020	200,000	1,000	260,000,000
4	Y	XS1541978851	LOGAN PROPERTY HOLDINGS	龙光地产	LOGPH 5 3/4 01/03/22	USD	92.656	8.354	14.370	8.354	2.981	B1	N/A	BB-	5.75	FIXED	Y	3/01/2020	102.875	3/01/2022	200,000	1,000	200,000,000
4	Y	XS1488049740	CHINA SOUTH CITY HOLDING	华南城	CSCHCN 6 3/4 09/13/21	USD	78.802	15.991	38.074	15.991	2.699	N/A	CCC+	B	6.75	FIXED	Y	13/09/2019	103.375	13/09/2021	200,000	1,000	346,500,000
4	Y	XS1555300497	YUZHOU PROPERTIES CO LTD	禹洲地产	YUZHOU 6 01/25/22	USD	93.513	8.260	13.576	8.260	3.032	B1	N/A	BB-	6	FIXED	Y	25/01/2020	103.000	25/01/2022	200,000	1,000	350,000,000
4	Y	XS1508493498	YUZHOU PROPERTIES CO LTD	禹洲地产	YUZHOU 6 10/25/23	USD	89.009	8.719	13.505	8.719	4.294	B1	N/A	BB-	6	FIXED	Y	25/10/2020	103.000	25/10/2023	200,000	1,000	250,000,000
4	Y	XS1241497384	CHINA SCE GRP HLDGS LTD	中骏置业	CHINSC 10 07/02/20	USD	104.329	7.337	17.473	7.308	0.749	B2	B	N/A	10	FIXED	Y	22/10/2018	105.000	2/07/2020	200,000	1,000	350,000,000
4	Y	XS1575984734	CHINA SCE GRP HLDGS LTD	中骏置业	CHINSC 5 7/8 03/10/22	USD	91.459	8.789	14.436	8.789	3.160	B2	B	N/A	5.875	FIXED	Y	10/03/2020	102.938	10/03/2022	200,000	1,000	500,000,000
4	N	XS1494003624	MODERN LAND CHINA CO LTD	当代置业	MOLAND 6 7/8 10/20/19	USD	92.471	14.704	14.704	14.704	1.020	B3	N/A	B+	6.875	FIXED	N	N/A	N/A	20/10/2019	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	XS1549245238	TIMES CHINA HLDG LTD	时代地产	TPHL 6 1/4 01/23/20	USD	99.201	6.879	14.679	6.879	1.285	B1	B	BB-	6.25	FIXED	Y	23/01/2019	102.000	23/01/2020	200,000	1,000	375,000,000
4	Y	XS1269824964	OCEANWIDE HLDGS INTL 15	泛海控股	FANHAI 9 5/8 08/11/20	USD	99.250	10.060	80.826	10.060	1.746	N/A	CCC-	B-	9.625	FIXED	Y	22/10/2018	104.813	11/08/2020	200,000	1,000	11,300,000
4	N	XS1567240418	XINYUAN REAL ESTATE	鑫苑置业	XIN 7 3/4 02/28/21	USD	83.298	16.349	16.349	16.349	2.227	N/A	B-	B	7.75	FIXED	N	N/A	N/A	28/02/2021	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	XS1398697026	CHN AOYUAN PROPERTY GRP	中国奥园	CAPG 6.525 04/25/19	USD	100.827	5.065	5.065	5.065	0.570	B2	N/A	BB-	6.525	FIXED	N	N/A	N/A	25/04/2019	200,000	1,000	250,000,000
4	Y	XS1543555533	CHN AOYUAN PROPERTY GRP	中国奥园	CAPG 6.35 01/11/20	USD	98.979	7.177	7.177	7.177	1.251	B2	B	BB-	6.35	FIXED	N	N/A	N/A	11/01/2020	200,000	1,000	425,000,000
4	N	XS0876181537	FANTASIA HOLDINGS GROUP	花样年	FTHDGR 10 3/4 01/22/20	USD	96.947	13.301	67.414	13.301	1.251	B3	B	N/A	10.75	FIXED	Y	1/11/2018	102.688	22/01/2020	200,000	1,000	250,000,000
4	Y	XS1498418224	FANTASIA HOLDINGS GROUP	花样年	FTHDGR 7 3/8 10/04/21	USD	80.171	15.872	35.277	15.872	2.619	B3	B	N/A	7.375	FIXED	Y	4/10/2019	103.688	4/10/2021	200,000	1,000	500,000,000
4	N	XS1324204160	POWERLONG REAL ESTATE HL	宝龙地产	PWRLNG 7 5/8 11/26/18	USD	100.505	4.556	4.556	4.556	0.172	B2	B	N/A	7.625	FIXED	N	N/A	N/A	26/11/2018	200,000	1,000	350,000,000
5	N	XS1489814779	POWERLONG REAL ESTATE	宝龙地产	PWRLNG 4 7/8 09/15/21	USD	86.901	10.079	22.991	10.079	2.787	B2	B	N/A	4.875	FIXED	Y	15/09/2019	102.438	15/09/2021	200,000	1,000	200,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
4	Y	USG98100AA11	WUZHOU INTL HOLDINGS LTD	五洲国际	WUJINTL 13 3/4 09/26/18	USD	48.482	#####	#####	#####	0.006	Ca	N/A	WD	13.75	DEFAULTED	Y	N/A	N/A	26/09/2018	200,000	1,000	300,000,000
5	Y	XS1535978800	FRANSHION BRILLIANT LTD	中国金茂	CHJMAO 5 3/4 PERP	USD	92.425	7.137	8.412	7.137	3.020	Ba2	N/A	N/A	5.75	VARIABLE	Y	17/01/2022	100.000	永续债	200,000	1,000	500,000,000
4	N	XS1521768058	YANLORD LAND HK CO LTD	仁恒置地	YLLGSP 5 7/8 01/23/22	USD	99.674	5.981	8.262	5.981	3.044	Ba3	BB-	N/A	5.875	FIXED	Y	23/01/2020	102.938	23/01/2022	200,000	1,000	450,000,000
5	Y	XS1549621586	NEW WORLD CHINA LAND LTD	新世界中国地产	NEWWOR 4 3/4 01/23/27	USD	98.293	5.002	5.002	5.002	6.907	N/A	N/A	N/A	4.75	FIXED	N	N/A	N/A	23/01/2027	200,000	1,000	600,000,000
4	Y	XS1560668425	XINHU ZHONGBAO	新湖中宝	XINHUZ 6 03/01/20	USD	88.118	15.537	15.537	15.537	1.390	B3	B-	B	6	FIXED	N	N/A	N/A	1/03/2020	200,000	1,000	700,000,000
3	Y	XS1081319698	GREENLAND GLB INVST	绿地集团	GRNLGR 4 3/8 07/03/19	USD	98.639	6.190	6.190	6.190	0.764	Ba2	BB-	BB-	4.375	FIXED	N	N/A	N/A	3/07/2019	200,000	1,000	400,000,000
4	Y	XS1081321595	GREENLAND GLB INVST	绿地集团	GRNLGR 5 7/8 07/03/24	USD	85.544	9.149	9.149	9.149	4.830	Ba2	BB-	BB-	5.875	FIXED	N	N/A	N/A	3/07/2024	200,000	1,000	600,000,000
4	Y	XS1562292026	KEEN IDEA GLOBAL LTD	北京建设	BEIPRO 4 3/8 03/08/20	USD	93.537	9.218	9.218	9.218	1.422	N/A	N/A	N/A	4.375	FIXED	N	N/A	N/A	8/03/2020	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	XS1583026080	GUORUI PROPERTIES LTD	国瑞置业	GUOPRO 7 03/21/20	USD	85.875	18.237	41.577	41.577	0.492	N/A	CCC+	B	7	FIXED	Y	21/03/2019	100.000	21/03/2020	200,000	1,000	300,000,000
城投债																							
4	Y	XS1432554761	XZ ECO TECH DEV ZONE INT	徐州经济 技术开发区 国有资产经营	XZETDZ 4 1/2 06/16/19	USD	98.324	6.887	6.887	6.887	0.717	N/A	N/A	BB	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	16/06/2019	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	XS1493428855	ZHONGGUAN CUN HLD GP INT	江苏中关村 控股集团	ZGCHGI 5.7 11/08/19	USD	97.922	7.658	30.860	22.685	0.122	N/A	N/A	N/A	5.7	FIXED	Y	8/11/2018	101.000	8/11/2019	200,000	1,000	220,000,000
4	Y	XS1552613660	QINGHAI INVEST GROUP	青海省投资集团	QHINVG 7 1/4 02/22/20	USD	73.428	32.076	32.076	32.076	1.349	N/A	B+ *-	N/A	7.25	FIXED	N	N/A	N/A	22/02/2020	200,000	1,000	300,000,000
3	Y	XS1529837517	YUNNAN ENERGY INST OVR	云南省能源投资 集团有限公司	YUNAEN 3 1/2 12/13/19	USD	97.529	5.620	5.620	5.620	1.193	N/A	N/A	BBB	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	13/12/2019	200,000	1,000	310,000,000
4	Y	XS1588158342	HUANTAIHU INTL INV CO LT	湖州环太湖集团	HTHG 5 3/4 03/30/20	USD	98.633	6.712	6.712	6.712	1.434	N/A	N/A	N/A	5.75	FIXED	N	N/A	N/A	30/03/2020	200,000	1,000	150,000,000
3	Y	XS1598849708	SHANHAI HONG KONG INT IN	连云港港	LIANYU 3 7/8 04/20/20	USD	96.864	5.992	5.992	5.992	1.515	N/A	BBB- *	N/A	3.875	FIXED	N	N/A	N/A	20/04/2020	200,000	1,000	300,000,000
3	Y	XS1492597676	JINAN WEST CITY INVT	济南西城投资开 发集团有限公司	JNXCCC 3 1/8 10/11/21	USD	93.399	5.507	5.507	5.507	2.882	N/A	BBB-	BBB	3.125	FIXED	N	N/A	N/A	11/10/2021	200,000	1,000	300,000,000
工业类/其他企业债券																							
4	Y	XS1512652600	PANDA GREEN ENERGY GROUP	熊猫绿能	GDPOLY 8 1/4 01/25/20	USD	83.991	22.767	22.767	22.767	1.271	B3	B	N/A	8.25	FIXED	N	N/A	N/A	25/01/2020	200,000	1,000	350,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
4	N	USQ94606AE22	VIRGIN AUSTRALIA HOLDING	维珍澳大利亚控股有限公司	VAHAU 8 1/2 11/15/19	USD	101.898	6.732	6.732	6.732	1.082	B3	B-	N/A	8.5	FIXED	N	N/A	N/A	15/11/2019	2,000	1,000	400,000,000
4	N	USQ94606AG79	VIRGIN AUSTRALIA HOLDING	维珍澳大利亚控股有限公司	VAHAU 7 7/8 10/15/21	USD	99.580	8.030	8.030	8.030	2.684	B3	B-	N/A	7.875	FIXED	N	N/A	N/A	15/10/2021	2,000	1,000	350,000,000
4	N	XS1266660635	SOFTBANK GROUP CORP	软银集团股份 有限公司	SOFTBK 5 3/8 07/30/22	USD	102.517	4.652	4.608	4.608	3.299	Ba1	BB+	N/A	5.375	FIXED	Y	30/04/2022	100.000	30/07/2022	200,000	1,000	818,521,000
4	N	XS1266660122	SOFTBANK GROUP CORP	软银集团股份 有限公司	SOFTBK 6 07/30/25	USD	102.832	5.497	5.483	5.483	5.516	Ba1	BB+	N/A	6	FIXED	Y	30/04/2025	100.000	30/07/2025	200,000	1,000	711,627,000
4	N	USG11259AB79	HEALTH AND HAPPINESS H&H	H&H国际控股	BTSDF 7 1/4 06/21/21	USD	103.771	5.739	5.086	4.442	0.725	Ba3	BB+	N/A	7.25	FIXED	Y	22/10/2018	103.625	21/06/2021	200,000	1,000	600,000,000
4	N	XS1259361050	HNA GROUP INTL CO LTD	海航集团	SANYPH 8 1/8 12/03/18	USD	96.324	27.628	27.628	27.628	0.192	N/A	N/A	N/A	8.125	FIXED	N	N/A	N/A	3/12/2018	200,000	1,000	473,000,000
4	N	XS1475043060	HNA GROUP INTL CO LTD	海航集团	SANYPH 6 08/18/19	USD	92.179	15.628	15.628	15.628	0.885	N/A	N/A	N/A	6	FIXED	N	N/A	N/A	18/08/2019	200,000	1,000	300,000,000
4	N	XS1499773098	HNA GROUP INTL CO LTD	海航集团	SANYPH 6 1/4 10/05/21	USD	82.648	13.402	13.402	13.402	2.686	N/A	N/A	N/A	6.25	FIXED	N	N/A	N/A	5/10/2021	200,000	1,000	200,000,000
4	Y	XS1331758737	BLUE SKY FLIERS CO LTD	香港航空	HONAIR 6.9 01/20/19	USD	97.507	14.825	14.825	14.825	0.322	N/A	N/A	N/A	6.9	FIXED	N	N/A	N/A	20/01/2019	200,000	1,000	550,000,000
5	Y	XS1526108235	BLUE SKYVIEW CO LTD	香港航空	HONAIR 7 1/8 PERP	USD	86.848	13.912	15.607	13.912	1.729	N/A	N/A	N/A	7.125	VARIABLE	Y	26/07/2020	100.000	永续债	200,000	1,000	683,000,000
4	Y	XS1572352653	GRAND CHINA AIR HONG KON	大新华航空	GRCHAR 6 3/8 03/07/19	USD	90.816	29.258	29.258	29.258	0.453	N/A	N/A	N/A	6.375	FIXED	N	N/A	N/A	7/03/2019	200,000	1,000	450,000,000
4	Y	XS1415758991	361 DEGREES INTL LTD	3 6 1 度	DEGREE 7 1/4 06/03/21	USD	95.372	9.222	19.815	9.222	2.433	N/A	BB	BB	7.25	FIXED	Y	3/06/2019	103.625	3/06/2021	200,000	1,000	400,000,000
4	Y	XS1107316041	WEST CHINA CEMENT LTD	西部水泥	WESCHI 6 1/2 09/11/19	USD	101.336	5.060	10.058	5.060	0.948	Ba3	B+	BB-	6.5	FIXED	Y	22/10/2018	101.625	11/09/2019	200,000	1,000	400,000,000
4	N	USY9896RAB79	ZOOMLION HK SPV CO LTD	中联重科	ZOOMLI 6 1/8 12/20/22	USD	95.961	7.245	7.245	7.245	3.726	N/A	B	B-	6.125	FIXED	N	N/A	N/A	20/12/2022	200,000	1,000	600,000,000
4	Y	XS1163232900	CAR INC	神州租车	CARINC 6 1/8 02/04/20	USD	98.060	7.644	71.225	7.644	1.316	Ba3	BB	WD	6.125	FIXED	Y	22/10/2018	103.063	4/02/2020	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	XS1266590089	CAR INC	神州租车	CARINC 6 02/11/21	USD	95.041	8.334	113.129	8.334	2.235	Ba3	BB	WD	6	FIXED	Y	22/10/2018	103.000	11/02/2021	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	XS1132375897	CHINA OIL AND GAS GROUP	中油燃气	CHIOIL 5 05/07/20	USD	100.182	4.878	6.693	4.878	1.548	Ba2	BB	N/A	5	FIXED	Y	7/05/2019	101.250	7/05/2020	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	USG9844KAB55	YINGDE GASES INVSTMT LTD	盈德气体	YINGDZ 7 1/4 02/28/20	USD	101.428	6.185	34.818	6.185	1.376	B2	B	B+	7.25	FIXED	Y	22/10/2018	103.625	28/02/2020	200,000	1,000	220,829,000
4	Y	XS1581103428	FORTUNE STAR BVI LTD	复星国际	FOSUNI 5 1/4 03/23/22	USD	94.181	7.160	11.239	7.160	3.230	N/A	BB	N/A	5.25	FIXED	Y	23/03/2020	102.625	23/03/2022	200,000	1,000	1,400,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
4	Y	USG3958RAB53	GOLDEN EAGLE RETAIL GRP	金鷹商贸	GERGHK 4 5/8 05/21/23	USD	90.259	7.116	7.116	7.116	4.146	B1	BB-	BB	4.625	FIXED	N	N/A	N/A	21/05/2023	200,000	1,000	400,000,000
4	N	USG85381AA26	STUDIO CITY FINANCE LTD	新濠影汇	STCITY 8 1/2 12/01/20	USD	100.982	7.992	22.379	3.110	0.186	B2	B+	N/A	8.5	FIXED	Y	22/10/2018	102.125	1/12/2020	250,000	1,000	825,000,000
4	N	US71645WAR25	PETROBRAS GLOBAL FINANCE	巴西国家石油	PETBRA 5 3/8 01/27/21	USD	101.826	4.541	4.541	4.541	2.216	Ba2	BB-	BB-	5.375	FIXED	N	N/A	N/A	27/01/2021	200,000	1,000	1,216,850,000
4	N	US71647NAF69	PETROBRAS GLOBAL FINANCE	巴西国家石油	PETBRA 4 3/8 05/20/23	USD	93.680	5.947	5.947	5.947	4.181	Ba2	BB-	BB-	4.375	FIXED	N	N/A	N/A	20/05/2023	200,000	1,000	3,500,000,000
4	N	US71647NAM11	PETROBRAS GLOBAL FINANCE	巴西国家石油	PETBRA 6 1/4 03/17/24	USD	98.650	6.547	6.547	6.547	4.712	Ba2	BB-	BB-	6.25	FIXED	N	N/A	N/A	17/03/2024	200,000	1,000	2,500,000,000
5	N	US71647NAA72	PETROBRAS GLOBAL FINANCE	巴西国家石油	PETBRA 5 5/8 05/20/43	USD	79.312	7.473	7.473	7.473	11.985	Ba2	BB-	BB-	5.625	FIXED	N	N/A	N/A	20/05/2043	200,000	1,000	834,606,000
5	N	US71647NAK54	PETROBRAS GLOBAL FINANCE	巴西国家石油	PETBRA 7 1/4 03/17/44	USD	91.303	8.059	8.059	8.059	11.378	Ba2	BB-	BB-	7.25	FIXED	N	N/A	N/A	17/03/2044	200,000	1,000	2,000,000,000
5	N	US71647NAN93	PETROBRAS GLOBAL FINANCE	巴西国家石油 (百年債)	PETBRA 6.85 06/05/15	USD	82.353	8.317	8.317	8.317	12.223	Ba2	BB-	BB-	6.85	FIXED	N	N/A	N/A	5/06/2115	200,000	1,000	2,500,000,000
3	N	XS0799357354	SBERBANK (SB CAP SA)	俄罗斯联邦 储蓄银行	SBERRU 5.18 06/28/19	USD	100.462	4.546	4.546	4.546	0.749	Ba1	N/A	BBB-	5.18	FIXED	N	N/A	N/A	28/06/2019	200,000	1,000	1,000,000,000
3	N	XS0743596040	SBERBANK (SB CAP SA)	俄罗斯联邦 储蓄银行	SBERRU 6 1/8 02/07/22	USD	102.602	5.270	5.270	5.270	3.077	Ba1	N/A	BBB-	6.125	FIXED	N	N/A	N/A	7/02/2022	200,000	1,000	1,500,000,000
4	N	XS0548633659	VTB BANK (VTB CAPITAL SA)	俄罗斯 外贸银行	VTB 6.551 10/13/20	USD	102.068	5.470	5.470	5.470	1.901	Ba1	BBB-	WD	6.551	FIXED	N	N/A	N/A	13/10/2020	100,000	1,000	826,960,000
5	N	XS0223715920	VTB BANK (VTB CAPITAL SA)	俄罗斯 外贸银行	VTB 6 1/4 06/30/35	USD	104.020	5.869	5.869	5.869	10.605	Ba1	BBB-	WD	6.25	FIXED	N	N/A	N/A	30/06/2035	100,000	1,000	22,513,000
5	Y	XS1520804250	FWD LTD	富卫人寿保险	FWDINS 6 1/4 PERP	USD	99.887	7.142	6.284	6.284	3.031	Ba2	N/A	BB+	6.25	VARIABLE	Y	24/01/2022	100.000	永续債	200,000	1,000	250,000,000
4	Y	XS1555631925	PB INTERNATION AL BV	Pan Brothers	PBRXIJ 7 5/8 01/26/22	USD	91.687	10.640	17.474	10.640	2.956	B1	N/A	B	7.625	FIXED	Y	26/01/2020	103.813	26/01/2022	200,000	1,000	200,000,000
5	Y	XS1542976003	NEW ROSE INVESTMENTS LTD	爪哇控股	SEAHDL 4 1/2 01/19/20	USD	98.578	5.628	5.628	5.628	1.286	N/A	N/A	N/A	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	19/01/2020	200,000	1,000	200,000,000
4	Y	XS1565411250	CHINA SINGYES SOLAR TECH	兴业太阳能	CSSXF 7.95 02/15/19	USD	82.893	61.642	61.642	61.642	0.392	N/A	N/A	N/A	7.95	FIXED	N	N/A	N/A	15/02/2019	200,000	1,000	260,000,000
4	Y	XS1581385900	GUANGHUI INVESTMENT GR	新疆广汇	GUANGH 7 7/8 03/30/20	USD	86.580	18.410	18.410	18.410	1.394	B3	B-	N/A	7.875	FIXED	N	N/A	N/A	30/03/2020	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	XS1522916805	TOP WISE EXCELLENCE ENTE	康德新	KANGDE 6 03/16/20	USD	88.943	14.582	14.582	14.582	1.432	B1	N/A	BB	6	FIXED	N	N/A	N/A	16/03/2020	200,000	1,000	300,000,000
5	N	XS1580239207	LEGAL & GENERAL GROUP	Legal & General Group PLC	LGEN 5 1/4 03/21/47	USD	96.844	6.248	5.724	5.724	6.926	A3	BBB+	BBB+	5.25	VARIABLE	Y	21/03/2027	100.000	21/03/2047	200,000	1,000	850,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增额	流通额
投资级别债券																							
香港企业类																							
3	Y	XS0493535966	CLP POWER HK FINANCING	中电控股	CHINLP 4 3/4 03/19/20	USD	101.889	3.435	3.435	3.435	1.452	A1	A+	N/A	4.75	FIXED	N	N/A	N/A	19/03/2020	100,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS0635017196	CLP POWER HK FINANCING	中电控股	CHINLP 4 3/4 07/12/21	USD	103.113	3.570	3.570	3.570	2.635	A1	A+	N/A	4.75	FIXED	N	N/A	N/A	12/07/2021	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	XS0846197019	CLP POWER HK FINANCING	中电控股	CHINLP 2 7/8 04/26/23	USD	96.382	3.740	3.740	3.740	4.274	A1	A+	N/A	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	26/04/2023	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	XS1226628961	CLP POWER HK FINANCING	中电控股	CHINLP 3 1/8 05/06/25	USD	95.390	3.922	3.922	3.922	5.937	A1	A+	N/A	3.125	FIXED	N	N/A	N/A	6/05/2025	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	XS0848445358	CLP POWER HK FINANCING	中电控股	CHINLP 3 3/8 10/26/27	USD	95.267	4.001	4.001	4.001	7.754	A1	A+	N/A	3.375	FIXED	N	N/A	N/A	26/10/2027	200,000	1,000	300,000,000
5	Y	XS1064021246	CLP POWER HK FINANCE LTD	中电控股	CHINLP 4 1/4 PERP	USD	100.518	4.808	3.770	3.770	1.089	A3	A-	N/A	4.25	VARIABLE	Y	7/11/2019	100.000	永续债	200,000	1,000	750,000,000
4	Y	XS1078750004	GOODMAN HK FINANCE	嘉民物流	GOOMAN 4 3/8 06/19/24	USD	100.102	4.354	4.354	4.354	5.078	N/A	BBB+	N/A	4.375	FIXED	N	N/A	N/A	19/06/2024	200,000	1,000	400,000,000
5	Y	XS1022151416	TOWNGAS FINANCE LTD	香港中华煤气	HKCGAS 4 3/4 PERP	USD	100.462	5.509	3.368	3.368	0.344	A3	A-	N/A	4.75	VARIABLE	Y	28/01/2019	100.000	永续债	200,000	1,000	300,000,000
3	Y	XS0565475505	HONGKONG ELECTRIC FIN	电能实业 (港灯)	HKE 4 1/4 12/14/20	USD	101.538	3.522	3.522	3.522	2.121	N/A	A-	N/A	4.25	FIXED	N	N/A	N/A	14/12/2020	100,000	1,000	750,000,000
3	N	XS0782786171	HONGKONG LAND FINANCE	香港置地	HKLSP 4 1/2 06/01/22	USD	102.698	3.709	3.709	3.709	3.396	A2	A	N/A	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	1/06/2022	200,000	1,000	500,000,000
4	N	XS1002158027	HONGKONG LAND FINANCE	香港置地	HKLSP 4 5/8 01/16/24	USD	104.010	3.783	3.783	3.783	4.744	A2	A	N/A	4.625	FIXED	N	N/A	N/A	16/01/2024	200,000	1,000	400,000,000
4	N	XS0546241075	HONGKONG LAND FINANCE	香港置地	HKLSP 4 1/2 10/07/25	USD	103.300	3.958	3.958	3.958	6.006	A2	A	Au	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	7/10/2025	100,000	1,000	600,000,000
3	Y	XS0871996491	HYSAN (MTN) LIMITED	希慎兴业	HYSAN 3 1/2 01/16/23	USD	98.618	3.850	3.850	3.850	4.011	A3	BBB+	BBB+	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	16/01/2023	200,000	1,000	300,000,000
3	N	US50074KAA97	KOWLOON- CANTON RAILWAY	九广铁路公司	KCRC 5 1/8 05/20/19	USD	101.268	3.149	3.149	3.149	0.643	Aa2	AA+	WD	5.125	FIXED	N	N/A	N/A	20/05/2019	100,000	1,000	750,000,000
3	N	XS0611607879	WISEYEAR HOLDINGS LTD	嘉里建设	KERPRO 5 7/8 04/06/21	USD	103.925	4.224	4.224	4.224	2.333	N/A	NR	N/A	5.875	FIXED	N	N/A	N/A	6/04/2021	200,000	1,000	300,000,000
3	Y	XS1495978329	TVB FINANCE LTD	电视广播	TVB 3 5/8 10/11/21	USD	98.969	3.987	3.987	3.987	2.864	N/A	N/A	N/A	3.625	FIXED	N	N/A	N/A	11/10/2021	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS0507147725	LI & FUNG LTD	利丰	LIFUNG 5 1/4 05/13/20	USD	101.658	4.187	4.187	4.187	1.562	Baa2	BBB+	N/A	5.25	FIXED	N	N/A	N/A	13/05/2020	100,000	1,000	750,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增额	流通额
5	N	XS1389118453	LI & FUNG LTD	利丰	LIFUNG 5 1/4 PERP	USD	72.661	7.225	16.909	7.225	13.951	Ba1	BBB-	N/A	5.25	FIXED	Y	3/11/2021	100.000	永续债	200,000	1,000	650,000,000
3	Y	XS0841191991	LS FINANCE 2022 LTD	利福国际	LIHHK 4 1/4 10/16/22	USD	97.833	4.843	4.843	4.843	3.699	Ba2u	N/A	BB+u	4.25	FIXED	N	N/A	N/A	16/10/2022	200,000	1,000	300,000,000
3	N	XS0831371264	NAN FUNG TREASURY LTD	南丰集团	NANFUN 4 1/2 09/20/22	USD	100.955	4.237	4.237	4.237	3.696	Baa3	BBB-	BBB	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	20/09/2022	200,000	1,000	300,000,000
4	N	XS1072402925	NAN FUNG TREASURY LTD	南丰集团	NANFUN 4 7/8 05/29/24	USD	101.278	4.615	4.615	4.615	4.960	Baa3	BBB-	BBB	4.875	FIXED	N	N/A	N/A	29/05/2024	200,000	1,000	200,000,000
3	Y	XS0554846781	SUN HUNG KAI PROP (CAP)	新鸿基地产	SUNHUN 4 11/02/20	USD	100.828	3.587	3.587	3.587	2.010	A1	A+	Au	4	FIXED	N	N/A	N/A	2/11/2020	100,000	1,000	300,000,000
3	Y	XS0744757526	SUN HUNG KAI PROP (CAP)	新鸿基地产	SUNHUN 4 1/2 02/14/22	USD	102.350	3.754	3.754	3.754	3.169	A1	A+	Au	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	14/02/2022	200,000	1,000	900,000,000
3	Y	XS0873639701	SUN HUNG KAI PROP (CAP)	新鸿基地产	SUNHUN 3 5/8 01/16/23	USD	99.338	3.792	3.792	3.792	4.002	A1	A+	Au	3.625	FIXED	N	N/A	N/A	16/01/2023	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	XS1036235882	SUN HUNG KAI PROP (CAP)	新鸿基地产	SUNHUN 3 3/8 02/25/24	USD	99.938	4.415	3.515	3.515	0.419	A1	A+	Au	3.375	VARIABLE	Y	25/02/2019	100.000	25/02/2024	200,000	1,000	400,000,000
3	Y	XS0899374002	SWIRE PROPERT MTN FIN	太古地产	SWIPRO 2 3/4 03/07/20	USD	98.853	3.566	3.566	3.566	1.432	A2	NR	N/A	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	7/03/2020	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS0794206465	SWIRE PROPERT MTN FIN	太古地产	SWIPRO 4 3/8 06/18/22	USD	102.031	3.785	3.785	3.785	3.450	A2	NR	A	4.375	FIXED	N	N/A	N/A	18/06/2022	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS0446665886	SWIRE PACIFIC MTN FIN	太古股份	SWIRE 5 1/2 08/19/19	USD	101.895	3.347	3.347	3.347	0.890	A3	A-	A-	5.5	FIXED	N	N/A	N/A	19/08/2019	100,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS0751513572	SWIRE PACIFIC MTN FIN	太古股份	SWIRE 4 1/2 02/28/22	USD	102.302	3.777	3.777	3.777	3.208	A3	A-	A-	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	28/02/2022	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	XS0979067427	SWIRE PACIFIC MTN FIN	太古股份	SWIRE 4 1/2 10/09/23	USD	102.328	3.985	3.985	3.985	4.483	A3	A-	N/A	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	9/10/2023	200,000	1,000	700,000,000
2	Y	XS1019652368	WHARF FINANCE LTD	九龙仓	WHARF 3 1/2 01/23/19	USD	100.012	3.443	3.443	3.443	0.331	N/A	N/A	BBB	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	23/01/2019	200,000	1,000	400,000,000
4	Y	XS1106513762	FWD LTD	富卫保险	FWDINS 5 09/24/24	USD	101.234	4.761	4.761	4.761	5.263	Baa3	N/A	BBB	5	FIXED	N	N/A	N/A	24/09/2024	200,000	1,000	325,000,000
3	N	USG4672UAA37	HUTCH WHAM INT 09 LTD	和记黄埔	CKHH 7 5/8 04/09/19	USD	102.455	3.017	3.017	3.017	0.524	A2	A-	A-	7.625	FIXED	N	N/A	N/A	9/04/2019	100,000	1,000	1,500,000,000
3	N	USG4671AAA81	HUTCHISON WHAM INT 09/19	和记黄埔	CKHH 5 3/4 09/11/19	USD	102.458	3.140	3.140	3.140	0.950	A2	A-	A-	5.75	FIXED	N	N/A	N/A	11/09/2019	100,000	1,000	1,000,000,000
3	N	USG4673GAB17	HUTCH WHAMPOA INT 11 LTD	和记黄埔	CKHH 4 5/8 01/13/22	USD	102.652	3.762	3.762	3.762	3.078	A2	A-	A-	4.625	FIXED	N	N/A	N/A	13/01/2022	200,000	1,000	1,430,000,000
3	N	USG4690AAB38	HUTCH WHAMPOA INT 12 II	和记黄埔	CKHH 3 1/4 11/08/22	USD	97.907	3.803	3.803	3.803	3.841	A2	A-	A-	3.25	FIXED	N	N/A	N/A	8/11/2022	200,000	1,000	500,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
4	N	USG46747AB00	HUTCH WHAMPOA INT 14 LTD	和记黄埔	CKHH 3 5/8 10/31/24	USD	97.988	3.999	3.999	3.999	5.440	A2	A-	A-	3.625	FIXED	N	N/A	N/A	31/10/2024	200,000	1,000	1,500,000,000
4	N	USG46715AC56	HUTCHISON WHAMPOA FIN	和记黄埔	CKHH 7 1/2 08/01/27	USD	123.938	4.229	4.229	4.229	6.824	A2	A-	A-	7.5	FIXED	N	N/A	N/A	1/08/2027	100,000	1,000	309,000,000
5	N	USG4672CAC94	HUTCHISON WHAM INT 03/33	和记黄埔	CKHH 7.45 11/24/33	USD	133.255	4.417	4.417	4.417	9.977	A2	A-	A-	7.45	FIXED	N	N/A	N/A	24/11/2033	100,000	1,000	1,144,000,000
3	N	USG22117AB45	HPHT FINANCE 15 LTD	和记港口 控股信托	HPHTSP 2 7/8 03/17/20	USD	98.997	3.576	3.576	3.576	1.459	Baa1	BBB+	N/A	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	17/03/2020	200,000	1,000	500,000,000
3	N	XS0900763029	PCCW-HKT CAPITAL NOS LTD	电讯盈科	PCCW 3 3/4 03/08/23	USD	98.568	4.105	4.105	4.105	4.135	Baa2	BBB	N/A	3.75	FIXED	N	N/A	N/A	8/03/2023	200,000	1,000	500,000,000
4	N	XS1213177295	HKT CAPITAL NO 2 LTD	电讯盈科	PCCW 3 5/8 04/02/25	USD	96.107	4.316	4.316	4.316	5.747	Baa2	BBB	N/A	3.625	FIXED	N	N/A	N/A	2/04/2025	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	XS1588424678	EMPEROR INT HOLDINGS LTD	英皇集团	EMPINT 5 03/30/22	USD	96.147	6.237	6.237	6.237	3.183	N/A	N/A	N/A	5	FIXED	N	N/A	N/A	30/03/2022	200,000	1,000	200,000,000
内地房地产类																							
2	Y	XS1430441490	CSCEC FINANCE CAYMAN II	中国建筑股份	CHCONS 2 1/4 06/14/19	USD	99.067	3.567	3.567	3.567	0.717	A2	A	A	2.25	FIXED	N	N/A	N/A	14/06/2019	200,000	1,000	500,000,000
2	Y	XS0984184316	CHINA OVERSEA FIN KY III	中国海外发展	CHIOLI 3 3/8 10/29/18	USD	100.056	2.760	2.760	2.760	0.097	Baa1	BBB+	A-	3.375	FIXED	N	N/A	N/A	29/10/2018	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1063561143	CHINA OVERSEAS FIN KY VI	中国海外发展	CHIOLI 4 1/4 05/08/19	USD	100.430	3.540	3.540	3.540	0.612	Baa1	BBB+	A-	4.25	FIXED	N	N/A	N/A	8/05/2019	200,000	1,000	800,000,000
3	Y	XS0508012092	CHINA OVRSEA FIN KY II	中国海外发展	CHIOLI 5 1/2 11/10/20	USD	103.207	3.912	3.912	3.912	2.000	Baa1	BBB+	N/A	5.5	FIXED	N	N/A	N/A	10/11/2020	100,000	1,000	1,000,000,000
3	Y	XS0852986156	CHINA OVERSEAS FIN KY V	中国海外发展	CHIOLI 3.95 11/15/22	USD	98.658	4.306	4.306	4.306	3.805	Baa1	BBB+	N/A	3.95	FIXED	N	N/A	N/A	15/11/2022	200,000	1,000	700,000,000
4	Y	XS0972980097	CHINA OVERSEA FIN KY III	中国海外发展	CHIOLI 5 3/8 10/29/23	USD	104.085	4.469	4.469	4.469	4.448	Baa1	BBB+	A-	5.375	FIXED	N	N/A	N/A	29/10/2023	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	XS1063561499	CHINA OVERSEAS FIN KY VI	中国海外发展	CHIOLI 5.95 05/08/24	USD	106.875	4.549	4.549	4.549	4.791	Baa1	BBB+	A-	5.95	FIXED	N	N/A	N/A	8/05/2024	200,000	1,000	700,000,000
5	Y	XS1075180379	CHINA OVERSEAS FIN. VI	中国海外发展	CHIOLI 6.45 06/11/34	USD	114.765	5.074	5.074	5.074	10.344	Baa1	BBB+	A-	6.45	FIXED	N	N/A	N/A	11/06/2034	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	XS0852986313	CHINA OVERSEAS FIN KY V	中国海外发展	CHIOLI 5.35 11/15/42	USD	102.240	5.186	5.186	5.186	13.690	Baa1	BBB+	N/A	5.35	FIXED	N	N/A	N/A	15/11/2042	200,000	1,000	300,000,000
5	Y	XS0985567881	CHINA OVERSEA FIN KY III	中国海外发展	CHIOLI 6 3/8 10/29/43	USD	116.394	5.198	5.198	5.198	13.420	Baa1	BBB+	A-	6.375	FIXED	N	N/A	N/A	29/10/2043	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS0996662853	CHINA OS GRAND OCEAN FIN	中国海外宏洋	COGO 5 1/8 01/23/19	USD	100.354	4.005	4.005	4.005	0.331	Baa2	BBB-	BBB	5.125	FIXED	N	N/A	N/A	23/01/2019	200,000	1,000	400,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人 / 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增额	流通额
3	Y	XS1048622689	POLY REAL ESTATE FINANCE	保利地产	POLYRE 5 1/4 04/25/19	USD	100.703	4.018	4.018	4.018	0.573	Baa3	BBB-	BBB+	5.25	FIXED	N	N/A	N/A	25/04/2019	200,000	1,000	398,405,000
3	Y	XS1089807025	SINO OCEAN LND TRS FIN I	远洋地产	SINOCE 4 5/8 07/30/19	USD	100.371	4.170	4.170	4.170	0.839	Baa3	NR	BBB-	4.625	FIXED	N	N/A	N/A	30/07/2019	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1163228627	SINO OCEAN LD TRS FIN II	远洋地产	SINOCE 4.45 02/04/20	USD	99.881	4.537	4.537	4.537	1.329	Baa3	NR	BBB-	4.45	FIXED	N	N/A	N/A	4/02/2020	200,000	1,000	700,000,000
4	Y	XS1090864528	SINO OCEAN LND TRS FIN I	远洋地产	SINOCE 6 07/30/24	USD	100.988	5.797	5.797	5.797	4.982	Baa3	NR	BBB-	6	FIXED	N	N/A	N/A	30/07/2024	200,000	1,000	700,000,000
4	Y	XS1163722587	SINO OCEAN LD TRS FIN II	远洋地产	SINOCE 5.95 02/04/27	USD	100.340	5.897	5.897	5.897	6.657	Baa3	NR	BBB-	5.95	FIXED	N	N/A	N/A	4/02/2027	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS0955717946	FRANSHION BRILLIANT LTD	方兴地产 (母:中化)	CHJMAO 5 3/8 10/17/18	USD	100.124	3.351	3.351	3.351	0.064	Baa3	BBB-	BBB-	5.375	FIXED	N	N/A	N/A	17/10/2018	200,000	1,000	131,109,000
3	Y	XS1038803190	FRANSHION BRILLIANT LTD	方兴地产 (母:中化)	CHJMAO 5 3/4 03/19/19	USD	100.968	3.720	3.720	3.720	0.486	Baa3	BBB-	BBB-	5.75	FIXED	N	N/A	N/A	19/03/2019	200,000	1,000	500,000,000
3	N	USG3709DAA03	FRANSHION DEVELOPMEN T	方兴地产 (母:中化)	CHJMAO 6 3/4 04/15/21	USD	105.204	4.570	4.570	4.570	2.332	Baa3	BBB-	BBB-	6.75	FIXED	N	N/A	N/A	15/04/2021	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	HK0000175114	VANKE REAL ESTATE HK	万科	VNKRLE 4 1/2 12/04/18	CNY	100.125	3.803	3.803	3.803	0.189	Baa2	BBB	BBB+	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	4/12/2018	1,000,000	10,000	1,000,000,000
3	Y	XS0989286850	WANDA PROPERTIES OVERSEA	大连万达 商业地产	DALWAN 4 7/8 11/21/18	USD	99.993	4.839	4.839	4.839	0.158	Ba3	B+	BB+	4.875	FIXED	N	N/A	N/A	21/11/2018	200,000	1,000	600,000,000
4	Y	XS1023280271	WANDA PROPERTIES INTL	大连万达 商业地产	DALWAN 7 1/4 01/29/24	USD	95.753	8.245	8.245	8.245	4.456	Ba3	B+	BB+	7.25	FIXED	N	N/A	N/A	29/01/2024	200,000	1,000	600,000,000
3	Y	XS0878083517	LEADING AFFLUENCE LTD	越秀地产	YUEXIU 4 1/2 01/24/23	USD	94.516	5.952	5.952	5.952	3.943	Baa3	N/A	BBB-	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	24/01/2023	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	XS1105268228	LINK FINANCE CAYMAN 2009	领汇REITs	LINREI 3.6 09/03/24	USD	98.251	3.933	3.933	3.933	5.385	A2	A	N/A	3.6	FIXED	N	N/A	N/A	3/09/2024	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1039273740	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	CRHZCH 4 3/8 02/27/19	USD	100.331	3.573	3.573	3.573	0.425	Baa1	BBB+	BBB+	4.375	FIXED	N	N/A	N/A	27/02/2019	200,000	1,000	800,000,000
4	Y	XS1039273666	CHINA RESOURCES LAND LTD	华润置地	CRHZCH 6 02/27/24	USD	107.733	4.382	4.382	4.382	4.722	Baa1	BBB+	BBB+	6	FIXED	N	N/A	N/A	27/02/2024	200,000	1,000	700,000,000
3	Y	XS1132156230	DOUBLE ROSY LTD	中粮置地	COFCOL 3 5/8 11/18/19	USD	99.529	4.045	4.045	4.045	1.123	N/A	N/A	A	3.625	FIXED	N	N/A	N/A	18/11/2019	200,000	1,000	800,000,000
3	N	XS1157365070	SHIMAO PROPERTY HLDGS	世茂房地产	SHIMAO 8 3/8 02/10/22	USD	105.490	6.533	4.627	4.627	0.378	Ba3	BB	BBB-	8.375	FIXED	Y	10/02/2019	104.188	10/02/2022	200,000	1,000	1,100,000,000
中国资产管理类																							
3	Y	USG2117CAB84	CHINA CINDA FINANCE	中国信达 资产管理	CCAMCL 4 05/14/19	USD	100.132	3.783	3.783	3.783	0.629	Baa1	A-	A	4	FIXED	N	N/A	N/A	14/05/2019	200,000	1,000	1,000,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
2	Y	XS1573134878	CHINA CINDA FINANCE 2017	中国信达 资产管理	CCAMCL 3 03/09/20	USD	98.640	3.968	3.968	3.968	1.436	Baa1	A-	A	3	FIXED	N	N/A	N/A	9/03/2020	200,000	1,000	300,000,000
3	Y	USG21184AA79	CHINA CINDA FINANCE 2015	中国信达 资产管理	CCAMCL 3 1/8 04/23/20	USD	98.675	3.997	3.997	3.997	1.534	Baa1	A-	A	3.125	FIXED	N	N/A	N/A	23/04/2020	200,000	1,000	1,300,000,000
3	Y	XS1573134522	CHINA CINDA FINANCE 2017	中国信达 资产管理	CCAMCL 3.65 03/09/22	USD	98.229	4.205	4.205	4.205	3.274	Baa1	A-	A	3.65	FIXED	N	N/A	N/A	9/03/2022	200,000	1,000	1,300,000,000
3	Y	XS1573134951	CHINA CINDA FINANCE 2017	中国信达 资产管理	CCAMCL 4.1 03/09/24	USD	97.539	4.615	4.615	4.615	4.930	Baa1	A-	A	4.1	FIXED	N	N/A	N/A	9/03/2024	200,000	1,000	700,000,000
4	Y	USG2117CAC67	CHINA CINDA FINANCE	中国信达 资产管理	CCAMCL 5 5/8 05/14/24	USD	104.975	4.612	4.612	4.612	4.839	Baa1	A-	A	5.625	FIXED	N	N/A	N/A	14/05/2024	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	USG21184AB52	CHINA CINDA FINANCE 2015	中国信达 资产管理	CCAMCL 4 1/4 04/23/25	USD	97.205	4.749	4.749	4.749	5.692	Baa1	A-	A	4.25	FIXED	N	N/A	N/A	23/04/2025	200,000	1,000	1,700,000,000
4	Y	XS1573135099	CHINA CINDA FINANCE 2017	中国信达 资产管理	CCAMCL 4.4 03/09/27	USD	95.921	4.997	4.997	4.997	7.107	Baa1	A-	A	4.4	FIXED	N	N/A	N/A	9/03/2027	200,000	1,000	700,000,000
2	Y	XS1508916639	CHINA GRT WALL INTL III	中国长城 资产管理	GRWALL 2 1/4 10/27/19	USD	98.285	3.868	3.868	3.868	1.075	Baa1	BBB+	A	2.25	FIXED	N	N/A	N/A	27/10/2019	200,000	1,000	700,000,000
3	Y	XS1508917017	CHINA GRT WALL INTL III	中国长城 资产管理	GRWALL 2 5/8 10/27/21	USD	95.522	4.183	4.183	4.183	2.954	Baa1	BBB+	A	2.625	FIXED	N	N/A	N/A	27/10/2021	200,000	1,000	800,000,000
2	Y	XS1317967062	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 2 7/8 11/19/18	USD	99.900	3.498	3.498	3.498	0.153	Baa1	BBB+	A	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	19/11/2018	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1422784212	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 2 3/4 06/03/19	USD	99.167	3.978	3.978	3.978	0.685	N/A	BBB+	A	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	3/06/2019	200,000	1,000	700,000,000
3	Y	XS1088292815	HUARONG FINANCE CO LTD	中国华融 资产管理	HRAM 4 07/17/19	USD	99.980	4.019	4.019	4.019	0.804	Baa1	BBB+	A	4	FIXED	N	N/A	N/A	17/07/2019	200,000	1,000	1,200,000,000
2	Y	XS1515240874	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 2 7/8 11/22/19	USD	98.667	4.060	4.060	4.060	1.140	N/A	BBB+	A	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	22/11/2019	200,000	1,000	1,000,000,000
3	Y	XS1165659357	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 4 1/2 01/16/20	USD	100.385	4.191	4.191	4.191	1.278	Baa1	BBB+	A	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	16/01/2020	200,000	1,000	1,200,000,000
2	Y	XS1555076329	HUARONG FINANCE 2017 CO	中国华融 资产管理	HRAM 3 3/8 01/24/20	USD	98.914	4.218	4.218	4.218	1.308	Baa1	N/A	A	3.375	FIXED	N	N/A	N/A	24/01/2020	200,000	1,000	1,100,000,000
3	Y	XS1317967146	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 3 3/4 11/19/20	USD	98.916	4.280	4.280	4.280	2.062	Baa1	BBB+	A	3.75	FIXED	N	N/A	N/A	19/11/2020	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1422785375	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 3 1/4 06/03/21	USD	97.062	4.418	4.418	4.418	2.572	N/A	BBB+	A	3.25	FIXED	N	N/A	N/A	3/06/2021	200,000	1,000	900,000,000
3	Y	XS1515239942	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 3 5/8 11/22/21	USD	97.660	4.425	4.425	4.425	2.977	N/A	BBB+	A	3.625	FIXED	N	N/A	N/A	22/11/2021	200,000	1,000	1,350,000,000
4	Y	XS1165659514	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 5 1/2 01/16/25	USD	101.482	5.220	5.220	5.220	5.372	Baa1	BBB+	A	5.5	FIXED	N	N/A	N/A	16/01/2025	200,000	1,000	1,400,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
4	Y	XS1317967492	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 5 11/19/25	USD	98.571	5.241	5.241	5.241	5.988	Baa1	BBB+	A	5	FIXED	N	N/A	N/A	19/11/2025	200,000	1,000	800,000,000
4	Y	XS1422790615	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 4 5/8 06/03/26	USD	95.520	5.342	5.342	5.342	6.433	N/A	BBB+	A	4.625	FIXED	N	N/A	N/A	3/06/2026	200,000	1,000	900,000,000
4	Y	XS1515240015	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 4 7/8 11/22/26	USD	96.867	5.353	5.353	5.353	6.692	N/A	BBB+	A	4.875	FIXED	N	N/A	N/A	22/11/2026	200,000	1,000	650,000,000
5	Y	XS1555076162	HUARONG FINANCE 2017 CO	中国华融 资产管理	HRAM 4 1/2 PERP	USD	96.441	9.420	5.685	5.685	3.105	Baa1	N/A	A-	4.5	VARIABLE	Y	24/01/2022	100.000	永续债	200,000	1,000	1,500,000,000
5	Y	XS1486060483	HUARONG FINANCE II	中国华融 资产管理	HRAM 2 7/8 PERP	USD	93.045	8.751	5.441	5.441	2.863	Baa1	N/A	A-	2.875	VARIABLE	Y	14/09/2021	100.000	永续债	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1104029027	CHARMING LIGHT INVST LTD	中国东方 资产管理	ORIEAS 3 3/4 09/03/19	USD	99.915	3.841	3.841	3.841	0.932	Baa1	N/A	A	3.75	FIXED	N	N/A	N/A	3/09/2019	200,000	1,000	1,100,000,000
3	Y	XS1481806799	CHARMING LIGHT INVST LTD	中国东方 资产管理	ORIEAS 2 3/8 08/30/21	USD	94.901	4.241	4.241	4.241	2.844	Baa1	N/A	A	2.375	FIXED	N	N/A	N/A	30/08/2021	200,000	1,000	650,000,000
4	Y	XS1104029290	CHARMING LIGHT INVST LTD	中国东方 资产管理	ORIEAS 5 09/03/24	USD	101.872	4.635	4.635	4.635	5.207	Baa1	N/A	A	5	FIXED	N	N/A	N/A	3/09/2024	200,000	1,000	400,000,000
保险类																							
2	Y	US00131M2A05	AIA GROUP LTD	友邦保险	AIA 2 1/4 03/11/19	USD	99.550	3.232	3.232	3.232	0.464	A2	A	N/A	2.25	FIXED	N	N/A	N/A	11/03/2019	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	HK0000142494	AIA GROUP LTD	友邦保险	AIA 3 1/8 03/13/23	USD	97.138	3.828	3.828	3.828	4.197	N/A	A	N/A	3.125	FIXED	N	N/A	N/A	13/03/2023	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	US00131M2B87	AIA GROUP LTD	友邦保险	AIA 4 7/8 03/11/44	USD	107.773	4.366	4.366	4.366	15.233	A2	A	N/A	4.875	FIXED	N	N/A	N/A	11/03/2044	200,000	1,000	500,000,000
5	N	XS1426796477	PRUDENTIAL PLC	英国保诚	PRUFIN 5 1/4 PERP	USD	97.367	5.392	6.324	5.428	18.613	A3	BBB+	BBB	5.25	FIXED	Y	20/07/2021	100.000	永续债	200,000	1,000	1,000,000,000
2	N	XS1344507899	PING AN LIFE INSURANCE	中国平安保险	PINGLI 2 3/8 01/19/19	USD	99.650	3.468	3.468	3.468	0.319	A3	N/A	N/A	2.375	FIXED	N	N/A	N/A	19/01/2019	200,000	1,000	700,000,000
3	N	XS1344507972	PING AN LIFE INSURANCE	中国平安保险	PINGLI 2 7/8 01/19/21	USD	97.902	3.827	3.827	3.827	2.249	A3	N/A	N/A	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	19/01/2021	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1547355427	TAIKANG INSURANCE GR	泰康人寿保险	TAIKAN 3 1/2 01/19/22	USD	97.918	4.177	4.177	4.177	3.142	N/A	N/A	BBB+	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	19/01/2022	200,000	1,000	800,000,000
5	N	XS0919401751	LA MONDIALE	LA MONDIALE	LAMON 7 5/8 PERP	USD	103.017	9.218	2.357	2.357	0.563	N/A	BBB	N/A	7.625	VARIABLE	Y	23/04/2019	100.000	永续债	200,000	1,000	600,000,000
3	Y	XS1572895198	CHINA REINSURANCE FIN	中国再保险	CNREFI 3 3/8 03/09/22	USD	94.924	4.991	4.991	4.991	3.283	N/A	N/A	N/A	3.375	FIXED	N	N/A	N/A	永续债	200,000	1,000	1,500,000,000
证券金融类																							

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人 / 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增额	流通额
3	Y	XS1130968453	CITIC SECURITIES FIN MTN	中信证券	CITICS 3 1/2 10/30/19	USD	99.607	3.866	3.866	3.866	1.074	Baa1	BBB+	N/A	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	30/10/2019	200,000	1,000	650,000,000
3	Y	XS1593370734	CITIC SECURITIES FIN MTN	中信证券	CITICS 3 1/4 04/20/22	USD	96.911	4.189	4.189	4.189	3.351	Baa1	N/A	N/A	3.25	FIXED	N	N/A	N/A	20/04/2022	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1411405233	CICC HK FINANCE 2016 MTN	中金国际	CICCHK 2 3/4 05/18/19	USD	99.440	3.625	3.625	3.625	0.643	N/A	BBB	BBB+	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	18/05/2019	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1107172535	HAITONG INTL FIN 2014	海通国际	HTISEC 3.99 09/11/19	USD	100.002	3.986	3.986	3.986	0.954	N/A	BBB	N/A	3.99	FIXED	N	N/A	N/A	11/09/2019	200,000	1,000	600,000,000
3	Y	XS1219829949	HAITONG INTL FIN HLDG 15	海通证券	HAISEC 3 1/2 04/21/20	USD	98.980	4.174	4.174	4.174	1.524	N/A	BBB	N/A	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	21/04/2020	200,000	1,000	670,000,000
3	Y	XS1170096454	HAITONG INTL FIN 2015	海通国际	HTISEC 4.2 07/29/20	USD	99.987	4.205	4.205	4.205	1.786	N/A	BBB	N/A	4.2	FIXED	N	N/A	N/A	29/07/2020	200,000	1,000	700,000,000
3	N	US38141GVP61	GOLDMAN SACHS GROUP INC	美商高盛证券	GS 2 3/4 09/15/20	USD	99.068	3.241	3.263	3.241	1.934	A3	BBB+	A	2.75	FIXED	Y	15/08/2020	100.000	15/09/2020	200,000	1,000	2,000,000,000
4	N	US38148LAE65	GOLDMAN SACHS GROUP INC	美商高盛证券	GS 3 3/4 05/22/25	USD	98.079	4.082	4.094	4.082	5.873	A3	BBB+	A	3.75	FIXED	Y	22/02/2025	100.000	22/05/2025	200,000	1,000	2,250,000,000
3	Y	XS1721764709	ORIENT HUIZHI LTD	东方证券	ORSECH 3 5/8 11/30/22	USD	95.309	4.877	4.877	4.877	3.866	Baa3	N/A	N/A	3.625	FIXED	N	N/A	N/A	30/11/2022	200,000	1,000	750,000,000
租赁类																							
4	N	US09681MAB46	BOC AVIATION LTD	中银航空租赁	BOCAVI 3 7/8 04/27/26	USD	95.804	4.534	4.554	4.534	6.517	N/A	A-	A-	3.875	FIXED	Y	27/01/2026	100.000	27/04/2026	200,000	1,000	750,000,000
2	Y	XS1379107565	AZURE ORBIT III INTL FIN	交银金融租赁	BOCOM 2 1/8 03/21/19	USD	99.391	3.384	3.384	3.384	0.492	A2	A-	N/A	2.125	FIXED	N	N/A	N/A	21/03/2019	200,000	1,000	400,000,000
3	Y	XS1379108456	AZURE ORBIT III INTL FIN	交银金融租赁	BOCOM 2 5/8 03/21/21	USD	96.936	3.928	3.928	3.928	2.427	A2	A-	N/A	2.625	FIXED	N	N/A	N/A	21/03/2021	200,000	1,000	600,000,000
3	Y	XS1422839727	CCBL CAYMAN 1 CORP	建银金融租赁	CCBL 2 3/8 05/31/19	USD	99.096	3.723	3.723	3.723	0.677	A2	N/A	A	2.375	FIXED	N	N/A	N/A	31/05/2019	200,000	1,000	400,000,000
3	Y	XS1422840733	CCBL CAYMAN 1 CORP	建银金融租赁	CCBL 2 3/4 05/31/21	USD	96.572	4.111	4.111	4.111	2.581	A2	N/A	A	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	31/05/2021	200,000	1,000	600,000,000
3	Y	XS1429589705	ABCL GLORY CAPITAL	农银金融租赁	AGRBK 2 1/2 06/21/21	USD	96.859	3.714	3.714	3.714	2.649	N/A	N/A	A	2.5	FIXED	N	N/A	N/A	21/06/2021	200,000	1,000	500,000,000
2	Y	USY3R559AE22	ICBCIL FINANCE CO LTD	工银国际租赁财 务	ICBCIL 2.6 11/13/18	USD	99.905	3.270	3.270	3.270	0.136	A2	A	A	2.6	FIXED	N	N/A	N/A	13/11/2018	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	USY3R559AJ19	ICBCIL FINANCE CO LTD	工银国际租赁财 务	ICBCIL 2 3/8 05/19/19	USD	99.174	3.664	3.664	3.664	0.647	NR	A	A	2.375	FIXED	N	N/A	N/A	19/05/2019	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1202242712	ICBCIL FINANCE CO LTD	工银国际租赁财 务	ICBCIL 3 1/4 03/17/20	USD	99.091	3.887	3.887	3.887	1.457	A2	N/A	A	3.25	FIXED	N	N/A	N/A	17/03/2020	200,000	1,000	600,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增额	流通额
3	Y	USY3R559AF96	ICBCIL FINANCE CO LTD	工银国际租赁财 务	ICBCIL 3.2 11/10/20	USD	98.468	3.956	3.956	3.956	2.049	A2	A	A	3.2	FIXED	N	N/A	N/A	10/11/2020	200,000	1,000	700,000,000
3	Y	USY3R559AK81	ICBCIL FINANCE CO LTD	工银国际租赁财 务	ICBCIL 2 3/4 05/19/21	USD	96.588	4.120	4.120	4.120	2.550	NR	A	A	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	19/05/2021	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	USY3R559AL64	ICBCIL FINANCE CO LTD	工银国际租赁财 务	ICBCIL 3 5/8 05/19/26	USD	93.426	4.655	4.655	4.655	6.625	NR	A	A	3.625	FIXED	N	N/A	N/A	19/05/2026	200,000	1,000	300,000,000
银行金融类																							
2	Y	XS1573944524	CHINA DEVELOPMEN T BK/HK	国家开发银行 股份有限公司	SDBC 0 03/06/20	USD	100.064	2.848	2.848	2.848	0.203	A1	A+	N/A	2.8728	FLOATING	N	N/A	N/A	6/03/2020	200,000	1,000	850,000,000
3	Y	XS1422299518	CHINA DEVELOPMEN T BANK	国家开发银行 股份有限公司	SDBC 2 1/8 06/01/21	USD	96.251	3.601	3.601	3.601	2.606	A1	A+	N/A	2.125	FIXED	N	N/A	N/A	1/06/2021	200,000	1,000	1,000,000,000
3	Y	XS1573944870	CHINA DEVELOPMEN T BK/HK	国家开发银行 股份有限公司	SDBC 0 03/06/22	USD	100.116	3.005	3.005	3.005	0.203	A1	A+	N/A	3.0228	FLOATING	N	N/A	N/A	6/03/2022	200,000	1,000	1,150,000,000
3	Y	XS1553211134	CHINA DEVELOPMEN T BANK	国家开发银行 股份有限公司	SDBC 2 5/8 01/24/22	USD	96.777	3.660	3.660	3.660	3.197	A1	A+	N/A	2.625	FIXED	N	N/A	N/A	24/01/2022	200,000	1,000	1,000,000,000
4	Y	XS1422334448	CHINA DEVELOPMEN T BANK	国家开发银行 股份有限公司	SDBC 3 06/01/26	USD	93.571	3.979	3.979	3.979	6.822	A1	A+	N/A	3	FIXED	N	N/A	N/A	1/06/2026	200,000	1,000	600,000,000
5	Y	XS1553212371	CHINA DEVELOPMEN T BANK	国家开发银行 股份有限公司	SDBC 4 01/24/37	USD	95.829	4.332	4.332	4.332	12.947	A1	A+	N/A	4	FIXED	N	N/A	N/A	24/01/2037	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS0561639211	FUBON BANK HONG KONG LTD	富邦香港	FUBON 6 1/8 11/30/20	USD	103.976	4.197	4.197	4.197	2.043	N/A	BBB	N/A	6.125	FIXED	N	N/A	N/A	30/11/2020	100,000	1,000	200,000,000
2	N	XS1308276168	AGRICULTURA L BK OF CHINA	农业银行	AGRBK 2 1/8 10/20/18	USD	99.925	3.137	3.137	3.137	0.072	A1	N/A	A	2.125	FIXED	N	N/A	N/A	20/10/2018	200,000	1,000	400,000,000
3	N	US00850XAC20	AGRICULTURA L BK CHINA/NY	农业银行	AGRBK 2 3/4 05/21/20	USD	98.665	3.585	3.585	3.585	1.618	A1	A	N/A	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	21/05/2020	250,000	1,000	500,000,000
2	Y	XS1016655349	BANK OF CHINA/HONG KONG	中银香港	BCHINA 3 1/8 01/23/19	USD	99.950	3.261	3.261	3.261	0.331	A1	N/A	A	3.125	FIXED	N	N/A	N/A	23/01/2019	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1252209322	BANK OF CHINA/HONG KONG	中银香港	BCHINA 2 7/8 06/30/20	USD	98.786	3.588	3.588	3.588	1.724	A1	N/A	A	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	30/06/2020	200,000	1,000	800,000,000
4	Y	XS1252209249	BANK OF CHINA/HONG KONG	中银香港	BCHINA 3 7/8 06/30/25	USD	98.384	4.151	4.151	4.151	5.956	A1	N/A	A	3.875	FIXED	N	N/A	N/A	30/06/2025	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	USY1391CAJ00	BANK OF CHINA HONG KONG	中银香港	BOCHKL 5.55 02/11/20	USD	102.953	3.340	3.340	3.340	1.341	A3	A	A-	5.55	FIXED	N	N/A	N/A	11/02/2020	100,000	1,000	1,623,251,000
3	N	XS0521073428	BANK OF EAST ASIA LTD	东亚银行	BNKEA 6 1/8 07/16/20	USD	103.971	3.831	3.831	3.831	1.726	Baa3	BBB	N/A	6.125	FIXED	N	N/A	N/A	16/07/2020	100,000	1,000	600,000,000
3	Y	XS1059004496	AZURE ORBIT II INTL FIN	交通银行	BOCOM 3 3/8 04/25/19	USD	99.986	3.396	3.396	3.396	0.578	N/A	A-	A	3.375	FIXED	N	N/A	N/A	25/04/2019	200,000	1,000	500,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
3	Y	XS0890073991	AZURE ORBIT INTL FINANCE	交通银行	BOCOM 3 3/4 03/06/23	USD	98.885	4.026	4.026	4.026	4.130	A2	A-	N/A	3.75	FIXED	N	N/A	N/A	6/03/2023	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1082890317	CHINA CONSTRUCT BK ASIA	建设银行	CCB 3 1/4 07/02/19	USD	99.845	3.451	3.451	3.451	0.764	A1	N/A	N/A	3.25	FIXED	N	N/A	N/A	2/07/2019	200,000	1,000	600,000,000
3	Y	XS1089991100	AIRVESSEL FINANCE HLDG	招商银行	CHINAM 3 1/4 08/11/19	USD	99.680	3.619	3.619	3.619	0.873	N/A	BBB+	N/A	3.25	FIXED	N	N/A	N/A	11/08/2019	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS0556302163	CHONG HING BANK LTD	创兴银行	CHOHIN 6 11/04/20	USD	103.466	4.263	4.263	4.263	1.973	Baa3	N/A	BBB-	6	FIXED	N	N/A	N/A	4/11/2020	100,000	1,000	204,024,000
3	Y	XS0611586263	CITIC LTD	中信股份	CITLTD 6 5/8 04/15/21	USD	106.125	4.078	4.078	4.078	2.337	A3	BBB+	N/A	6.625	FIXED	N	N/A	N/A	15/04/2021	100,000	1,000	750,000,000
3	N	XS0483583737	DAH SING BANK LTD	大新银行	DAHSIN 6 5/8 02/11/20	USD	103.296	4.139	4.139	4.139	1.334	Baa1	N/A	BBB	6.625	FIXED	N	N/A	N/A	11/02/2020	100,000	1,000	225,000,000
3	N	XS0483583737	DAH SING BANK LTD	大新银行	DAHSIN 6 5/8 02/11/20	USD	103.296	4.139	4.139	4.139	1.334	Baa1	N/A	BBB	6.625	FIXED	N	N/A	N/A	11/02/2020	100,000	1,000	225,000,000
3	N	XS0483583737	DAH SING BANK LTD	大新银行	DAHSIN 6 5/8 02/11/20	USD	103.296	4.139	4.139	4.139	1.334	Baa1	N/A	BBB	6.625	FIXED	N	N/A	N/A	11/02/2020	100,000	1,000	225,000,000
3	N	US45580KAC27	IND & COMM BK CHINA/NY	工商银行	ICBCAS 3.231 11/13/19	USD	99.652	3.544	3.544	3.544	1.112	A1	A	N/A	3.231	FIXED	N	N/A	N/A	13/11/2019	250,000	1,000	1,000,000,000
3	N	XS1237348070	IND & COMM BK CHN/DUBAI	工商银行	ICBCAS 2 5/8 05/26/20	USD	98.320	3.668	3.668	3.668	1.633	A1	N/A	N/A	2.625	FIXED	N	N/A	N/A	26/05/2020	200,000	1,000	500,000,000
2	N	US45580KAD00	IND & COMM BK CHINA/NY	工商银行	ICBCAS 2.157 11/13/18	USD	99.863	3.143	3.143	3.143	0.136	A1	A	N/A	2.157	FIXED	N	N/A	N/A	13/11/2018	250,000	1,000	300,000,000
3	N	US45580KAE82	IND & COMM BK CHINA/NY	工商银行	ICBCAS 2.905 11/13/20	USD	98.251	3.763	3.763	3.763	2.065	A1	A	N/A	2.905	FIXED	N	N/A	N/A	13/11/2020	250,000	1,000	700,000,000
3	N	XS1432570700	IND & COMM BK CHN/DUBAI	工商银行	ICBCAS 2 1/2 06/16/21	USD	96.620	3.815	3.815	3.815	2.635	A1	N/A	N/A	2.5	FIXED	N	N/A	N/A	16/06/2021	200,000	1,000	400,000,000
3	Y	XS0702140756	SKYSEA INTERNATION AL CAP	工商银行	ICBCAS 4 7/8 12/07/21	USD	103.003	3.867	3.867	3.867	2.967	A1	A	N/A	4.875	FIXED	N	N/A	N/A	7/12/2021	200,000	1,000	596,934,000
4	Y	XS1105630518	IND & COMM BK CHN MACAU	工商银行	ICBCAS 3 7/8 09/10/24	USD	99.726	5.021	4.167	4.167	0.952	NR	N/A	A-	3.875	VARIABLE	Y	10/09/2019	100.000	10/09/2024	200,000	1,000	320,000,000
3	N	XS0563742138	ICBC ASIA LTD	工银亚洲	ICBCAS 5 1/8 11/30/20	USD	102.586	3.876	3.876	3.876	2.064	Baa2	A-	WD	5.125	FIXED	N	N/A	N/A	30/11/2020	100,000	1,000	500,000,000
2	N	XS1327462492	KOREA DEVELOPMEN T BANK EXPORT-	韩国产业银行	KDB 4.2 12/15/18	CNY	99.951	4.347	4.300	4.300	0.230	Aa2	N/A	AA-	4.2	FIXED	N	N/A	N/A	15/12/2018	1,000,000	1,000,000	1,300,000,000
3	N	US302154AW97	IMPORT BANK KOREA EXPORT-	韩国输出银行	EIBKOR 5 1/8 06/29/20	USD	103.187	3.248	3.248	3.248	1.692	Aa2	AA	AA-	5.125	FIXED	N	N/A	N/A	29/06/2020	100,000	1,000	1,250,000,000
3	N	US302154BV06	IMPORT BANK KOREA	韩国输出银行	EIBKOR 2 5/8 12/30/20	USD	98.343	3.389	3.389	3.389	2.202	Aa2	AA	AA-	2.625	FIXED	N	N/A	N/A	30/12/2020	200,000	1,000	600,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
3	N	US82460EAK64	SHINHAN BANK	韩国输出银行	SHNHAN 2 7/8 03/28/22	USD	97.112	3.761	3.761	3.761	3.314	Aa3	A+	A	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	28/03/2022	200,000	1,000	500,000,000
3	N	XS1083308301	AMBANK M BHD	新韩银行	AMMMK 3 1/8 07/03/19	USD	99.625	3.615	3.615	3.615	0.767	Baa1	BBB+	N/A	3.125	FIXED	N	N/A	N/A	3/07/2019	200,000	1,000	400,000,000
3	N	XS0520490672	CHINA CITIC BANK INTL	中信银行国际	CINDBK 6 7/8 06/24/20	USD	104.454	4.203	4.203	4.203	1.655	Baa3	N/A	BBB-	6.875	FIXED	N	N/A	N/A	24/06/2020	100,000	1,000	500,000,000
3	Y	US00182FBC95	ANZ NEW ZEALAND INTL/LDN	澳新银行	ANZNZ 2 7/8 01/25/22	USD	97.325	3.734	3.734	3.734	3.188	A1	AA-	AA-	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	25/01/2022	200,000	1,000	700,000,000
3	N	XS1551709568	STATE BANK OF INDIA	印度国家银行	SBIIN 3 1/4 01/24/22	USD	97.024	4.215	4.215	4.215	3.167	Baa2	BBB-	BBB-	3.25	FIXED	N	N/A	N/A	24/01/2022	200,000	1,000	850,000,000
3	Y	XS1565690465	CHINA EVERBRIGHT BANK/HK	光大银行	CHEVBK 2 1/2 03/08/20	USD	98.074	3.873	3.873	3.873	1.437	N/A	N/A	BBB	2.5	FIXED	N	N/A	N/A	8/03/2020	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	US404280BJ78	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰	HSBC 3.262 03/13/23	USD	98.126	3.752	3.844	3.752	3.303	A2	A	AA-	3.262	VARIABLE	Y	13/03/2022	100	13/03/2023	200,000	1,000	2,500,000,000
4	Y	US404280BK42	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰	HSBC 4.041 03/13/28	USD	97.033	4.416	4.465	4.416	7.225	A2	A	AA-	4.041	VARIABLE	Y	13/03/2027	100	13/03/2028	200,000	1,000	2,500,000,000
城投债																							
3	y	XS1253824442	ZHAOHAI INVESTMENT BVI	天津滨海建设	BINHCO 4 07/23/20	USD	96.879	5.818	5.818	5.818	1.771	Baa2	BBB	A-	4	FIXED	N	N/A	N/A	23/07/2020	200,000	1,000	500,000,000
2	Y	XS1426796394	TIANJIN CITY CONSTRUCTIO	天津城市基础设施投资集团	TJNCON 2 3/4 06/15/19	USD	98.862	4.356	4.356	4.356	0.718	N/A	BBB+	A	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	15/06/2019	200,000	1,000	500,000,000
信息科技类																							
3	Y	XS1567423501	PROVEN GLORY CAPITAL LTD	华为	HUAWEI 3 1/4 02/21/22	USD	96.082	4.502	4.502	4.502	3.241	N/A	N/A	N/A	3.25	FIXED	N	N/A	N/A	21/02/2022	200,000	1,000	1,000,000,000
4	Y	XS1233275194	PROVEN HONOUR CAPITAL	华为	HUAWEI 4 1/8 05/19/25	USD	94.090	5.186	5.186	5.186	5.770	N/A	N/A	N/A	4.125	FIXED	N	N/A	N/A	19/05/2025	200,000	1,000	1,000,000,000
4	Y	XS1401816761	PROVEN HONOUR CAPITAL	华为	HUAWEI 4 1/8 05/06/26	USD	92.910	5.266	5.266	5.266	6.459	N/A	N/A	N/A	4.125	FIXED	N	N/A	N/A	6/05/2026	200,000	1,000	2,000,000,000
4	Y	XS1567423766	PROVEN GLORY CAPITAL LTD	华为	HUAWEI 4 02/21/27	USD	91.554	5.255	5.255	5.255	7.130	N/A	N/A	N/A	4	FIXED	N	N/A	N/A	21/02/2027	200,000	1,000	500,000,000
3	N	US47215PAB22	JD.COM INC	京东	JD 3 1/8 04/29/21	USD	97.250	4.254	4.254	4.254	2.482	Baa2	BBB-	N/A	3.125	FIXED	N	N/A	N/A	29/04/2021	200,000	1,000	500,000,000
4	N	US47215PAC05	JD.COM INC	京东	JD 3 7/8 04/29/26	USD	92.725	5.039	5.039	5.039	6.500	Baa2	BBB-	N/A	3.875	FIXED	N	N/A	N/A	29/04/2026	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	USG01719AB25	ALIBABA GROUP HOLDING	阿里巴巴	BABA 2 1/2 11/28/19	USD	99.532	2.905	2.937	2.905	1.159	A1	A+	A+	2.5	FIXED	Y	28/10/2019	100.000	28/11/2019	200,000	1,000	32,710,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人 / 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增额	流通额
3	Y	USG01719AA42	ALIBABA GROUP HOLDING	阿里巴巴	BABA 3 1/8 11/28/21	USD	98.792	3.529	3.551	3.529	3.019	A1	A+	A+	3.125	FIXED	Y	28/09/2021	100.000	28/11/2021	200,000	1,000	26,862,000
4	Y	USG01719AE63	ALIBABA GROUP HOLDING	阿里巴巴	BABA 3.6 11/28/24	USD	98.059	3.956	3.971	3.956	5.523	A1	A+	A+	3.6	FIXED	Y	28/08/2024	100.000	28/11/2024	200,000	1,000	16,569,000
5	Y	USG01719AF39	ALIBABA GROUP HOLDING	阿里巴巴	BABA 4 1/2 11/28/34	USD	97.982	4.679	4.683	4.679	11.441	A1	A+	A+	4.5	FIXED	Y	28/05/2034	100.000	28/11/2034	200,000	1,000	2,330,000
3	Y	US594918AL81	MICROSOFT CORP	微软	MSFT 4 02/08/21	USD	102.888	2.733	2.733	2.733	2.278	Aaa	AAA	AA+u	4	FIXED	N	N/A	N/A	8/02/2021	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	US594918AU80	MICROSOFT CORP	微软	MSFT 3 3/4 05/01/43	USD	97.463	3.911	3.913	3.911	15.914	Aaa	AAA	AA+u	3.75	FIXED	Y	1/11/2042	100.000	1/05/2043	200,000	1,000	500,000,000
3	N	US056752AD07	BAIDU INC	百度	BIDU 2 3/4 06/09/19	USD	99.662	3.233	3.233	3.233	0.702	A3	N/A	A	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	9/06/2019	200,000	1,000	1,000,000,000
3	N	US056752AF54	BAIDU INC	百度	BIDU 3 06/30/20	USD	99.200	3.469	3.469	3.469	1.723	A3	N/A	A	3	FIXED	N	N/A	N/A	30/06/2020	200,000	1,000	750,000,000
3	N	US056752AB41	BAIDU INC	百度	BIDU 3 1/2 11/28/22	USD	98.200	3.971	3.971	3.971	3.877	A3	N/A	A	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	28/11/2022	200,000	1,000	750,000,000
4	N	US056752AG38	BAIDU INC	百度	BIDU 4 1/8 06/30/25	USD	98.758	4.338	4.338	4.338	5.911	A3	N/A	A	4.125	FIXED	N	N/A	N/A	30/06/2025	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	US88032XAB01	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	TENCNT 3 3/8 05/02/19	USD	100.203	3.031	3.031	3.031	0.597	A1	A+	A+	3.375	FIXED	N	N/A	N/A	2/05/2019	200,000	1,000	2,000,000,000
3	Y	US88032XAC83	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	TENCNT 2 7/8 02/11/20	USD	99.420	3.307	3.307	3.307	1.359	A1	A+	A+	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	11/02/2020	200,000	1,000	1,100,000,000
4	Y	US88032XAD66	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯	TENCNT 3.8 02/11/25	USD	98.114	4.139	4.140	4.139	5.693	A1	A+	A+	3.8	FIXED	N	N/A	N/A	11/02/2025	200,000	1,000	900,000,000
3	N	US428236BV43	HP INC	惠普	HPQ 4.65 12/09/21	USD	103.731	3.411	3.411	3.411	2.984	Baa2	BBB	BBB+	4.65	FIXED	N	N/A	N/A	9/12/2021	200,000	1,000	695,162,000
5	N	XS1575529539	LENOVO PERPETUAL SECURIT	联想	LENOVO 5 3/8 PERP	USD	91.779	8.944	8.136	8.136	3.201	N/A	N/A	N/A	5.375	VARIABLE	Y	16/03/2022	100.000	Field Not App	200,000	1,000	1,000,000,000
3	Y	XS1573181440	LENOVO GROUP LTD	联想	LENOVO 3 7/8 03/16/22	USD	93.701	5.905	5.905	5.905	3.277	N/A	N/A	N/A	3.875	FIXED	N	N/A	N/A	16/03/2022	200,000	1,000	500,000,000
石油石化类																							
3	Y	US12634GAA13	CNOOC FINANCE 2015 AU	中国海洋石油	CNOOC 2 5/8 05/05/20	USD	98.708	3.454	3.454	3.454	1.575	A1	A+	N/A	2.625	FIXED	N	N/A	N/A	5/05/2020	200,000	1,000	1,500,000,000
3	Y	USG2353WAA92	CNOOC FINANCE 2011 LTD	中国海洋石油	CNOOC 4 1/4 01/26/21	USD	101.386	3.625	3.625	3.625	2.238	A1	A+	A+u	4.25	FIXED	N	N/A	N/A	26/01/2021	200,000	1,000	1,500,000,000
3	Y	USG23530AA92	CNOOC FINANCE 2012 LTD	中国海洋石油	CNOOC 3 7/8 05/02/22	USD	100.012	3.870	3.870	3.870	3.349	A1	A+	N/A	3.875	FIXED	N	N/A	N/A	2/05/2022	200,000	1,000	1,500,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
4	Y	US12625GAC87	CNOOC FINANCE 2013 LTD	中国海洋石油	CNOOC 3 05/09/23	USD	95.930	3.971	3.971	3.971	4.296	A1	A+	N/A	3	FIXED	N	N/A	N/A	9/05/2023	200,000	1,000	2,000,000,000
4	Y	USQ25738AA54	CNOOC CURTIS FUNDING NO1	中国海洋石油	CNOOC 4 1/2 10/03/23	USD	102.195	4.013	4.013	4.013	4.466	A1	A+	N/A	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	3/10/2023	200,000	1,000	1,300,000,000
4	Y	US12591DAC56	CNOOC FINANCE 2014 ULC	中国海洋石油	CNOOC 4 1/4 04/30/24	USD	100.808	4.086	4.086	4.086	4.962	A1	A+	A+	4.25	FIXED	N	N/A	N/A	30/04/2024	200,000	1,000	2,250,000,000
4	Y	US12634MAB63	CNOOC FINANCE 2015 US	中国海洋石油	CNOOC 3 1/2 05/05/25	USD	96.099	4.181	4.181	4.181	5.864	A1	A+	N/A	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	5/05/2025	200,000	1,000	2,000,000,000
5	Y	USG21886AB53	CNOOC FINANCE 2003 LTD	中国海洋石油	CNOOC 5 1/2 05/21/33	USD	110.827	4.484	4.484	4.484	10.324	A1	A+	A+u	5.5	FIXED	N	N/A	N/A	21/05/2033	200,000	1,000	300,000,000
5	Y	USG2353WAB75	CNOOC FINANCE 2011 LTD	中国海洋石油	CNOOC 5 3/4 01/26/41	USD	115.664	4.618	4.618	4.618	13.435	A1	A+	A+u	5.75	FIXED	N	N/A	N/A	26/01/2041	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	USG23530AB75	CNOOC FINANCE 2012 LTD	中国海洋石油	CNOOC 5 05/02/42	USD	105.286	4.629	4.629	4.629	14.103	A1	A+	N/A	5	FIXED	N	N/A	N/A	2/05/2042	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	US12591DAD30	CNOOC FINANCE 2014 ULC	中国海洋石油	CNOOC 4 7/8 04/30/44	USD	104.052	4.604	4.604	4.604	14.833	A1	A+	A+	4.875	FIXED	N	N/A	N/A	30/04/2044	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	US12634GAC78	CNOOC FINANCE 2015 AU	中国海洋石油	CNOOC 4.2 05/05/45	USD	93.420	4.632	4.632	4.632	15.616	A1	A+	N/A	4.2	FIXED	N	N/A	N/A	5/05/2045	200,000	1,000	300,000,000
3	Y	XS1267602214	COSL SINGAPORE CAPITAL	中海油田服务	COSL 3 1/2 07/30/20	USD	99.122	3.995	3.995	3.995	1.799	Baa1	BBB	A	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	30/07/2020	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	USG2444PAA50	COSL FINANCE BVI LTD	中海油田服务	COSL 3 1/4 09/06/22	USD	96.306	4.276	4.276	4.276	3.728	Baa1	BBB	A	3.25	FIXED	N	N/A	N/A	6/09/2022	200,000	1,000	1,000,000,000
4	Y	XS1267602305	COSL SINGAPORE CAPITAL	中海油田服务	COSL 4 1/2 07/30/25	USD	98.836	4.700	4.700	4.700	5.925	Baa1	BBB	A	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	30/07/2025	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	USG22004AG38	CNPC GENERAL CAPITAL LTD	中国石油财务	CNPCCH 2 3/4 05/14/19	USD	99.614	3.362	3.362	3.362	0.632	A2	A	A+	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	14/05/2019	200,000	1,000	750,000,000
3	Y	XS1143081963	CNPC GENERAL CAPITAL LTD	中国石油财务	CNPCCH 2.7 11/25/19	USD	99.209	3.393	3.393	3.393	1.149	A1	A+	A+	2.7	FIXED	N	N/A	N/A	25/11/2019	200,000	1,000	700,000,000
3	Y	USG21895AB60	CNPC HK OVERSEAS CAPITAL	中国石油财务	CNPCCH 4 1/2 04/28/21	USD	102.107	3.640	3.640	3.640	2.436	A2	A	A+	4.5	FIXED	N	N/A	N/A	28/04/2021	200,000	1,000	650,000,000
3	Y	USG22004AB41	CNPC GENERAL CAPITAL LTD	中国石油财务	CNPCCH 3.95 04/19/22	USD	100.424	3.821	3.821	3.821	3.309	A2	A	A+	3.95	FIXED	N	N/A	N/A	19/04/2022	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	USG22004AE89	CNPC GENERAL CAPITAL LTD	中国石油财务	CNPCCH 3.4 04/16/23	USD	97.798	3.932	3.932	3.932	4.196	A2	A	A+	3.4	FIXED	N	N/A	N/A	16/04/2023	200,000	1,000	750,000,000
5	Y	USG21895AC44	CNPC HK OVERSEAS CAPITAL	中国石油财务	CNPCCH 5.95 04/28/41	USD	118.715	4.608	4.608	4.608	13.272	A2	A	A+	5.95	FIXED	N	N/A	N/A	28/04/2041	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	USG81877AA34	SINOPEC CAPITAL 2013 LTD	中国石化	SINOPC 3 1/8 04/24/23	USD	96.247	4.029	4.029	4.029	4.242	A1	A+	N/A	3.125	FIXED	N	N/A	N/A	24/04/2023	200,000	1,000	1,250,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增额	流通额
5	Y	USG81877AD72	SINOPEC CAPITAL 2013 LTD	中国石化	SINOPC 4 1/4 04/24/43	USD	94.581	4.621	4.621	4.621	14.927	A1	A+	N/A	4.25	FIXED	N	N/A	N/A	24/04/2043	200,000	1,000	500,000,000
2	Y	USG8200QAA43	SINOPEC GRP OVERSEA 2013	中国石化	SINOPE 2 1/2 10/17/18	USD	99.960	3.094	3.094	3.094	0.064	A1	A+	N/A	2.5	FIXED	N	N/A	N/A	17/10/2018	200,000	1,000	750,000,000
3	Y	USG82003AC11	SINOPEC GRP OVERSEA 2014	中国石化	SINOPE 2 3/4 04/10/19	USD	99.693	3.322	3.322	3.322	0.538	A1	A+	N/A	2.75	FIXED	N	N/A	N/A	10/04/2019	200,000	1,000	750,000,000
3	Y	USG8201JAB73	SINOPEC GRP OVERSEA 2015	中国石化	SINOPE 2 1/2 04/28/20	USD	98.506	3.470	3.470	3.470	1.557	A1	A+	N/A	2.5	FIXED	N	N/A	N/A	28/04/2020	200,000	1,000	2,500,000,000
3	Y	USG8189YAB05	SINOPEC GRP OVERSEA 2012	中国石化	SINOPE 3.9 05/17/22	USD	100.122	3.863	3.863	3.863	3.390	A1	A+	N/A	3.9	FIXED	N	N/A	N/A	17/05/2022	200,000	1,000	1,500,000,000
4	Y	USG8200QAB26	SINOPEC GRP OVERSEA 2013	中国石化	SINOPE 4 3/8 10/17/23	USD	101.533	4.037	4.037	4.037	4.517	A1	A+	N/A	4.375	FIXED	N	N/A	N/A	17/10/2023	200,000	1,000	1,500,000,000
4	Y	USG82003AE76	SINOPEC GRP OVERSEA 2014	中国石化	SINOPE 4 3/8 04/10/24	USD	101.461	4.078	4.078	4.078	4.892	A1	A+	N/A	4.375	FIXED	N	N/A	N/A	10/04/2024	200,000	1,000	1,400,000,000
4	Y	USG8201JAC56	SINOPEC GRP OVERSEA 2015	中国石化	SINOPE 3 1/4 04/28/25	USD	94.322	4.246	4.246	4.246	5.885	A1	A+	N/A	3.25	FIXED	N	N/A	N/A	28/04/2025	200,000	1,000	1,500,000,000
5	Y	USG8189YAC87	SINOPEC GRP OVERSEA 2012	中国石化	SINOPE 4 7/8 05/17/42	USD	103.683	4.617	4.617	4.617	14.230	A1	A+	N/A	4.875	FIXED	N	N/A	N/A	17/05/2042	200,000	1,000	1,000,000,000
5	Y	USG8200QAC09	SINOPEC GRP OVERSEA 2013	中国石化	SINOPE 5 3/8 10/17/43	USD	111.208	4.616	4.616	4.616	14.332	A1	A+	N/A	5.375	FIXED	N	N/A	N/A	17/10/2043	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	USG8201JAE13	SINOPEC GRP OVERSEA 2015	中国石化	SINOPE 4.1 04/28/45	USD	92.297	4.605	4.605	4.605	15.704	A1	A+	N/A	4.1	FIXED	N	N/A	N/A	28/04/2045	200,000	1,000	800,000,000
4	N	XS1548865911	BPRL INTERNATION AL SINGA	新加坡BPRL	BPCLIN 4 3/8 01/18/27	USD	94.000	5.275	5.275	5.275	6.955	Baa2	N/A	BBB-	4.375	FIXED	N	N/A	N/A	18/01/2027	200,000	1,000	600,000,000
工业及其他企业类																							
3	N	USY3815NAX94	HYUNDAI CAPITAL SERVICES	现代汽车	HYUCAP 3 03/06/22	USD	96.600	4.066	4.066	4.066	3.295	Baa1	A-	BBB+	3	FIXED	N	N/A	N/A	6/03/2022	200,000	1,000	600,000,000
3	N	XS0881550684	HAINAN AIRLINE HK	海南航空	HAIAIR 3 5/8 02/07/20	USD	99.305	4.150	4.150	4.150	1.343	A1	A	N/A	3.625	FIXED	N	N/A	N/A	7/02/2020	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	XS1511610906	CHALCO HK INVESTMENT	中国铝业	CHALUM 4 1/4 PERP	USD	96.336	9.562	5.544	5.544	2.900	N/A	N/A	BBB	4.25	VARIABLE	Y	7/11/2021	100	永续债	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	XS1431266847	CITIC LTD	中信集团	CITLTD 2.8 12/14/21	USD	96.117	4.097	4.097	4.097	3.077	A3	BBB+	N/A	2.8	FIXED	N	N/A	N/A	14/12/2021	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	XS1431266920	CITIC LTD	中信集团	CITLTD 3.7 06/14/26	USD	93.424	4.725	4.725	4.725	6.676	A3	BBB+	N/A	3.7	FIXED	N	N/A	N/A	14/06/2026	200,000	1,000	750,000,000
3	Y	XS0880288997	CHINA RAILWAY RESOURCES	中国中铁	CHRAIL 3.85 02/05/23	USD	98.873	4.134	4.134	4.134	4.036	N/A	BBB+	A-	3.85	FIXED	N	N/A	N/A	5/02/2023	200,000	1,000	500,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
4	Y	XS0928126340	CRCC YUXIANG LTD	中国铁建	RLCONS 3 1/2 05/16/23	USD	97.049	4.205	4.205	4.205	4.267	A3	A-	N/A	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	16/05/2023	200,000	1,000	800,000,000
2	Y	XS0972715261	CHINA URANIUM DEVELOPMEN	中广核	CHGDNU 3 1/2 10/08/18	USD	100.009	3.216	3.216	3.216	0.039	A3	N/A	A	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	8/10/2018	200,000	1,000	600,000,000
4	Y	XS1227947097	CGNPC INTERNATION AL LTD	中广核	CHGDNU 4 05/19/25	USD	97.850	4.375	4.375	4.375	5.815	A3	BBB+	A	4	FIXED	N	N/A	N/A	19/05/2025	200,000	1,000	600,000,000
3	Y	USG5320CAA65	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	KUNLEG 2 7/8 05/13/20	USD	98.634	3.742	3.742	3.742	1.594	A2	A	A	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	13/05/2020	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	USG5320CAB49	KUNLUN ENERGY CO LTD	昆仑能源	KUNLEG 3 3/4 05/13/25	USD	97.559	4.174	4.174	4.174	5.845	A2	A	A	3.75	FIXED	N	N/A	N/A	13/05/2025	200,000	1,000	500,000,000
3	N	XS1092649620	SHANGHAI ELC GRP GLB INV	上海电气	SECGRP 3 08/14/19	USD	99.409	3.679	3.679	3.679	0.881	A2	A	A	3	FIXED	N	N/A	N/A	14/08/2019	200,000	1,000	500,000,000
3	Y	USG8450LAB02	STATE GRID OVERSEAS INV	国家电网	CHGRID 2 1/8 05/18/21	USD	96.253	3.620	3.620	3.620	2.570	A1	A+	A+	2.125	FIXED	N	N/A	N/A	18/05/2021	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	USG8450LAC84	STATE GRID OVERSEAS INV	国家电网	CHGRID 2 7/8 05/18/26	USD	91.890	4.121	4.121	4.121	6.809	A1	A+	A+	2.875	FIXED	N	N/A	N/A	18/05/2026	200,000	1,000	500,000,000
4	Y	USG8450LAJ38	STATE GRID OVERSEAS INV	国家电网海外投 资有限公司	CHGRID 3 1/2 05/04/27	USD	95.049	4.190	4.190	4.190	7.369	A1	A+	N/A	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	4/05/2027	200,000	1,000	2,350,000,000
3	Y	XS1423709309	MIDEA INVST DEVELOPMEN T	美的	MIDEAZ 2 3/8 06/03/19	USD	99.154	3.621	3.621	3.621	0.686	N/A	A-	A-	2.375	FIXED	N	N/A	N/A	3/06/2019	200,000	1,000	700,000,000
3	N	US87973RAA86	TEMASEK FINANCIAL I LTD	淡马锡控股	TEMASE 4.3 10/25/19	USD	101.388	2.990	2.990	2.990	1.055	Aaa	AAA	N/A	4.3	FIXED	N	N/A	N/A	25/10/2019	250,000	1,000	1,500,000,000
3	N	US87973RAC43	TEMASEK FINANCIAL I LTD	淡马锡控股	TEMASE 2 3/8 01/23/23	USD	95.854	3.412	3.412	3.412	4.119	Aaa	AAA	N/A	2.375	FIXED	N	N/A	N/A	23/01/2023	250,000	1,000	1,200,000,000
5	N	US87973RAB69	TEMASEK FINANCIAL I LTD	淡马锡控股	TEMASE 5 3/8 11/23/39	USD	122.889	3.792	3.792	3.792	13.554	Aaa	AAA	N/A	5.375	FIXED	N	N/A	N/A	23/11/2039	250,000	1,000	500,000,000
3	N	USN93695BL23	VOLKSWAGEN INTL FIN NV	大众汽车 国际金融	VW 4 08/12/20	USD	101.079	3.402	3.402	3.402	1.826	A3	BBB+	N/A	4	FIXED	N	N/A	N/A	12/08/2020	100,000	1,000	750,000,000
3	N	XS0938722401	GLENCORE FUNDING LLC	嘉能可	GLENLN 2 1/2 01/15/19	USD	99.846	2.990	2.990	2.990	0.308	Baa2	BBB+	N/A	2.5	FIXED	N	N/A	N/A	15/01/2019	200,000	1,000	688,476,000
3	N	USC98874AM93	GLENCORE FINANCE CANADA	嘉能可	GLENLN 4 10/25/22	USD	100.620	4.083	4.083	4.083	3.731	Baa2	BBB+	N/A	4.25	FIXED	N	N/A	N/A	25/10/2022	200,000	1,000	996,100,000
3	Y	XS1549334503	CHANG DEVELOPMEN T INT	长发国际	CCUDIH 3 5/8 01/20/20	USD	97.764	5.395	5.395	5.395	1.295	Baa1	N/A	N/A	3.625	FIXED	N	N/A	N/A	20/01/2020	200,000	1,000	400,000,000
4	Y	XS1551355149	GOHL CAPITAL LTD	云顶	GENTMK 4 1/4 01/24/27	USD	95.036	4.984	4.984	4.984	7.015	Baa1	N/A	A-	4.25	FIXED	N	N/A	N/A	24/01/2027	200,000	1,000	1,500,000,000
3	Y	USY00130HS90	ADANI PORTS AND SPECIAL	印度阿达尼港口 和经济特区	ADSEZ 3.95 01/19/22	USD	98.199	4.539	4.539	4.539	3.120	Baa3	BBB-	BBB-	3.95	FIXED	N	N/A	N/A	19/01/2022	200,000	1,000	500,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
3	Y	XS1552721042	HUAXING INVESTMENT HOLDI	珠海华发	ZHHFGR 3 1/2 01/26/20	USD	98.042	5.027	5.027	5.027	1.313	N/A	N/A	BBB	3.5	FIXED	N	N/A	N/A	26/01/2020	200,000	1,000	300,000,000
4	Y	XS1552721043	CHINA STATE CON FIN II	China State Construction Finance	CHSCOI 3 7/8 11/29/27	USD	92.816	4.853	4.853	4.853	7.648	Baa2	N/A	BBB+	3.875	FIXED	N	N/A	N/A	29/11/2027	200,000	1,000	250,000,000
Coco债券 / 优先股																							
5	Y	US404280AT69	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	HSBC 6 3/8 PERP	USD	100.558	6.995	6.269	6.269	5.275	Baa3	N/A	BBB	6.375	VARIABLE	Y	30/03/2025	100.000	永续债	200,000	1,000	2,450,000,000
5	Y	US404280BC26	HSBC HOLDINGS PLC	汇丰控股	HSBC 6 7/8 PERP	USD	104.622	7.873	5.010	5.010	2.455	Baa3	N/A	BBB	6.875	VARIABLE	Y	1/06/2021	100.000	永续债	200,000	1,000	2,000,000,000
5	Y	USG84228CE61	STANDARD CHARTERED PLC	渣打集团	STANLN 6 1/2 PERP	USD	100.167	7.776	6.382	6.382	1.430	Ba1	BB-	BB+	6.5	VARIABLE	Y	2/04/2020	100.000	永续债	200,000	1,000	2,000,000,000
5	Y	US251525AN16	DEUTSCHE BANK AG	德意志银行	DB 7 1/2 PERP	USD	96.423	8.120	8.047	7.962	5.264	B1	B+	BB-	7.5	VARIABLE	Y	30/04/2025	100.000	永续债	200,000	200,000	1,500,000,000
5	Y	US98105HAE09	WOORI BANK	友利银行	WOORIB 4 1/2 PERP	USD	98.059	6.092	5.205	5.205	2.783	Ba2	BB+	N/A	4.5	VARIABLE	Y	27/09/2021	100.000	永续债	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	XS1484844656	DBS GROUP HOLDINGS LTD	星展银行	DBSSP 3.6 PERP	USD	97.365	5.323	4.563	4.563	2.821	Baa1	N/A	BBB	3.6	VARIABLE	Y	7/09/2021	100.000	永续债	200,000	1,000	750,000,000
5	Y	USQ08328AA64	AUST & NZ BANKING GRP/UK	澳新银行	ANZ 6 3/4 PERP	USD	104.736	7.057	5.974	5.974	6.082	Baa2	BB+	BBB	6.75	VARIABLE	Y	15/06/2026	100.000	永续债	200,000	1,000	1,000,000,000
5	Y	XS1122780106	BANK OF CHINA	中国银行	BCHINA 6 3/4 PERP	CNY	102.190	8.106	4.610	4.610	1.016	Ba1	BB	N/A	6.75	VARIABLE	Y	23/10/2019	100.000	永续债	2,000,000	10,000	39,940,000,000
5	Y	USY39656AA40	IND & COMM BK OF CHINA	工商银行	ICBCAS 6 PERP	USD	101.627	7.117	4.512	4.512	1.150	Ba1	BB-	N/A	6	VARIABLE	Y	10/12/2019	100.000	永续债	200,000	1,000	2,940,000,000
5	Y	XS1449306064	ICBC ASIA LTD	工银亚洲	ICBCAS 4 1/4 PERP	USD	95.561	6.077	5.978	5.978	2.669	Ba1	N/A	N/A	4.25	VARIABLE	Y	21/07/2021	100.000	永续债	200,000	1,000	1,000,000,000
5	Y	XS1328130197	CHINA CONSTRUCTIO N BANK	建设银行	CCB 4.65 PERP	USD	99.418	5.815	4.864	4.864	2.096	Ba1	BB-	N/A	4.65	VARIABLE	Y	16/12/2020	100.000	永续债	200,000	1,000	3,050,000,000
5	Y	XS1257592037	BANK OF COMMUNICAT IONS	交通银行	BOCOM 5 PERP	USD	100.007	6.166	4.926	4.926	1.800	Ba3	N/A	N/A	5	VARIABLE	Y	29/07/2020	100.000	永续债	200,000	1,000	2,450,000,000
5	Y	XS1514052585	HUIZHANG BANK	徽商银行	HSBANK 5 1/2 PERP	USD	95.057	7.215	7.188	7.089	2.815	N/A	N/A	N/A	5.5	VARIABLE	Y	10/11/2021	100.000	永续债	200,000	1,000	888,000,000
5	Y	XS1499209861	CHINA CITIC BANK INTL	中信银行	CINDBK 4 1/4 PERP	USD	94.176	6.118	6.382	6.118	2.827	Ba2	N/A	N/A	4.25	VARIABLE	Y	11/10/2021	100.000	永续债	200,000	1,000	500,000,000
5	Y	XS1055321993	CHINA CITIC BANK INTL LT	中信银行	CINDBK 7 1/4 PERP	USD	101.902	8.365	3.881	3.881	0.561	Ba2	N/A	N/A	7.25	VARIABLE	Y	22/04/2019	100.000	永续债	200,000	1,000	300,000,000
5	Y	XS1107229582	CHONG HING BANK LTD	创兴银行	CHOHIN 6 1/2 PERP	USD	102.031	7.362	4.407	4.407	0.957	Ba2	N/A	N/A	6.5	VARIABLE	Y	25/09/2019	100.000	永续债	200,000	1,000	300,000,000

产品 风险 等级	专业 投资者	ISIN Code	Name of the Issuer	发行人/担保人/ 母公司	债券代码	货币	参考 价格	到期 收益率	下一 赎回 收益率	最差 收益率	存续期	穆迪	标普	惠誉	票息	票息 型式	可赎回	下次 赎回日	下次 赎回价	到期日	最小 交易额	增額	流通額
5	Y	XS1326527246	BANK OF EAST ASIA LTD	东亚银行	BNKEA 5 1/2 PERP	USD	99.584	6.648	5.700	5.700	2.058	Ba2	BB	N/A	5.5	VARIABLE	Y	2/12/2020	100.000	永续债	150,000	1,000	650,000,000
5	Y	XS1496760239	CHINA CINDA ASSET MGMT	中国信达 资产管理	CCAMCL 4.45 PERP	USD	94.505	6.293	6.411	6.197	2.758	B1	N/A	N/A	4.45	VARIABLE	Y	30/09/2021	100.000	永续债	200,000	1,000	3,200,000,000
5	Y	USG84228CX43	STANDARD CHARTERED PLC	渣打银行	STANLN 7 3/4 PERP	USD	103.417	8.188	6.858	6.858	3.777	Ba1	BB-	BB+	7.75	VARIABLE	Y	2/04/2023	100.000	永续债	200,000	1,000	1,000,000,000
5	Y	XS1587865830	CHINA ZHESHANG BANK	浙商银行	ZHESHG 5.45 PERP	USD	93.184	6.722	7.578	6.613	3.201	N/A	N/A	N/A	5.45	VARIABLE	Y	29/03/2022	100.000	永续债	200,000	1,000	2,175,000,000
5	Y	XS1737621604	BANK OF CHONGQING CO LTD	重庆银行	BOCHON 5.4 PERP	USD	89.939	6.653	8.135	6.546	3.717	N/A	N/A	N/A	5.4	VARIABLE	Y	20/12/2022	100.000	永续债	200,000	1,000	750,000,000
5	Y	XS1688955001	BANK OF ZHENGZHOU CO LTD	郑州银行	CBZHZH 5 1/2 PERP	USD	89.763	6.995	8.407	6.877	3.534	N/A	N/A	N/A	5.5	VARIABLE	Y	18/10/2022	100.000	永续债	200,000	1,000	1,191,000,000
5	Y	XS1683139692	BANK OF QINGDAO	青岛银行	QDBANK 5 1/2 PERP	USD	90.790	7.082	8.141	6.960	3.667	N/A	N/A	N/A	5.5	VARIABLE	Y	19/09/2022	100.000	永续债	200,000	1,000	1,203,000,000

重要声明:

本文件所载数据乃保密讯息及只供参考之用。东方证券(香港)有限公司或其关联成员(统称「东方证券」)并无顾虑任何特定投资者之特定投资目标、财务状况、或风险承受程度，投资者在进行任何投资前，必须对其投资进行独立判断或在需要时寻求独立专业意见。

本文件所载数据并不拟发布予公众人士或提供予置身或居住于该等法律上限制东方证券（香港）发放此等数据之地区的人士或实体使用;及在任何地区向任何人士或实体进行认购或投资证券或投资产品的要约或游说乃属违法时,则上述数据不应视为向该等地区进行该等要约或游说。上述数据亦不拟提供作为专业意见,因此不应赖以作为专业意见。

请注意上述关于产品数据乃未获香港证券及期货事务监察委员会认可可向香港公众人士销售及未经任何香港的规管当局审核的基金/投资产品。任何投资均带有风险，投资者可能损失全部或部份投资金额。

投资者需详细阅读并了解产品详细说明书及/或产品备忘录及/或条款说明书及其他相关档(包括但不限于产品数据概要)(统称「产品说明书」)回购及赎回条款等，并明确同意接受本产品的相关交易条件及投资风险。你应就上述资料内容谨慎行事,如你对有关资料的任何内容有任何疑问,你应寻求独立专业意见。

本文件内所提及之价格仅供参考之用途，投资产品之价值及收入可能会浮动，包括受汇率、市场指数、有关公司相关资料或其他因素而变动。本文件内容可随时更改，东方证券（香港）并不承诺提供任何有关变更之通知。证券/投资产品过去的表现不可作为未来表现的指标，同时未来回报是不能保证的，投资者可能蒙受所有最初存入资金的损失。

虽然本文件所载数据来自或编写自东方证券（香港）相信是可靠之来源，惟东方证券（香港）并不明示或暗示地声明或保证任何该等数据之准确性、完整性或可靠性,惟东方证券（香港）不会就有关数据的遗漏、错误、不准确、不完整或其他情况或由于信赖有关数据而蒙受或招致的任何损失或损害(不论任何形式的直接、间接或相应的损失或其他经济损失)承担任何责任。

东方证券（香港）不会就第三方所提供的或引用自第三方的数据内容承担任何责任。未经东方证券（香港）事先书面授权，任何人不得为任何目的复制、分发、转发、发表本文件所载数据。