

中证报价固定收益凭证估值日报

2026年06月24日

一、市场动态

2026年6月24日中国人民银行以固定利率、数量招标方式开展了6625亿元7天期逆回购操作，全额满足了一级交易商需求。逆回购为7天期，投标量6625亿元。今日有4203亿元逆回购到期，公开市场净投放2422亿元。Shibor涨跌不一，隔夜Shibor跌4.7bp至1.408%，1周Shibor涨5.1bp至1.548%，2周Shibor涨1.8bp至1.533%，1月Shibor涨0.5bp至1.43%，3月Shibor涨0.5bp至1.436%，6月Shibor涨0.3bp至1.454%，9月Shibor涨0.2bp至1.473%，1年Shibor涨0.2bp至1.484%。

二、中证报价收益凭证估值情况

1. 收益凭证收益率曲线2日变动（BP）

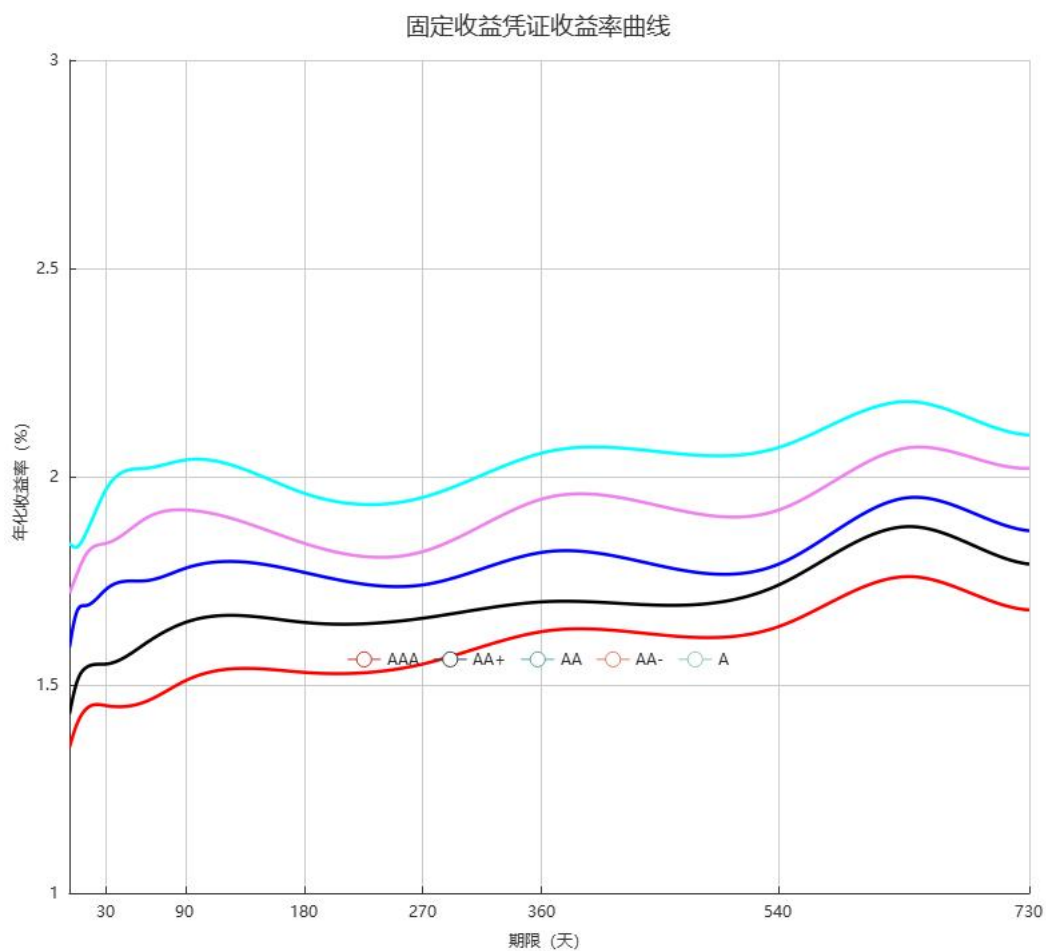
曲线名称	7D	14D	1M	3M	6M	9M	1Y
收益凭证收益率曲线（AAA）						3	
收益凭证收益率曲线（AA+）					2	3	
收益凭证收益率曲线（AA）							
收益凭证收益率曲线（AA-）							
收益凭证收益率曲线（A）							

2. 收益凭证各关键期限收益率（%）

曲线名称	7D	14D	1M	3M	6M	9M	1Y
收益凭证收益率曲线（AAA）	1.40	1.44	1.45	1.51	1.53	1.55	1.63
收益凭证收益率曲线（AA+）	1.50	1.54	1.55	1.65	1.65	1.66	1.70
收益凭证收益率曲线（AA）	1.67	1.69	1.73	1.78	1.77	1.74	1.82

收益凭证收益率曲线 (AA-)	1.76	1.81	1.84	1.92	1.84	1.82	1.95
收益凭证收益率曲线 (A)	1.83	1.86	1.97	2.04	1.96	1.95	2.06

三、中证报价收益凭证收益率曲线



声明:

1. 中证报价信用风险评价标识包括 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C, 各档次用“+”、“-”符号进行微调, 表示略高或略低于本等级, 微调不改变所在档次。该标识仅用于区分收益凭证发行人的偿债能力和偿债意愿, 为固定收益型收益凭证收益率曲线绘制及个券估值环节提供参考。各等级含义如下:

序号	等级符号	含义
----	------	----

1	AAA	偿还债务的能力极强，基本不受不利经济环境的影响，违约风险极低
2	AA	偿还债务的能力很强，受不利经济环境的影响不大，违约风险很低
3	A	偿还债务能力较强，较易受不利经济环境的影响，违约风险较低
4	BBB	偿还债务能力一般，受不利经济环境影响较大，违约风险一般
5	BB	偿还债务能力较弱，受不利经济环境影响很大，违约风险较高
6	B	偿还债务的能力较大地依赖于良好的经济环境，违约风险很高
7	CCC	偿还债务的能力极度依赖于良好的经济环境，违约风险极高
8	CC	在破产或重组时可获得保护较小，基本不能保证偿还债务
9	C	不能偿还债务

2. 当日发布的各档收益率曲线，主要依据次一交易日待发行产品价格信息及报价等信息编制，可作为次一交易日柜台市场收益凭证的价格中枢参考。中证机构间报价系统股份有限公司（以下简称“中证报价”）对本报告信息的准确性和完整性不作任何保证。本报告及其所含任何信息均不构成任何证券、金融产品或其他投资工具或任何交易策略的依据或建议。对任何因直接或间接使用本报告或其所含任何信息而造成的损失，中证报价不承担任何法律责任。本报告版权归中证报价所有，未经书面许可任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登。

今日业务咨询请联系：

赵志伟（收益率曲线）：电话（010）83897966/邮箱 zhaozhw@csmonitor.cn