

美元債券參考報價表

2/23/2015

發行機構	Ticker	SP/Mdy's/ Fitch	票面利率	付息頻率	到期日	參考賣價 (%)	參考買價 (%)	買回收益 (%)	到期收益 (%)	次順位	最低交易面額	ISIN Code / BB
美元債券--低風險(10年內到期,信評A-/A3以上)												
加拿大主權債	CANADA	AAA/Aaa/AAA	0.875	2	2/14/2017	99.22	101.34	-	0.19	N	65,000	US427028AA35
荷蘭主權債	NETHER	//AAA	1.000	2	2/24/2017	99.33	101.46	-	0.27	N	65,000	XS0749484217
美國公債	T	Aaa/AA+/AAA	2.500	2	8/15/2023	102.67	104.70	-	1.90	-	65,000	US912828VS66
阿拉伯聯合大公國	DUGB	Aaa/AA+/AAA	7.750	2	10/5/2020	123.14	125.86	-	2.74	-	100,000	XS0546428144
卡達電訊	QTELQD	A-/A2/A+	4.500	2	1/31/2043	100.35	103.43	-	4.29	N	200,000	XS0881740384
阿聯酋銀行	EBIUH	/Baa1/A+	4.625	2	3/28/2017	103.66	106.25	-	1.57	N	200,000	XS0765257141
中國石油天然氣集團	CNPCCB	A+/A1/A+	3.950	2	4/19/2022	101.34	103.96	-	3.32	N	200,000	USG22004AB41
新韓銀行	SHNHAN	A/A1/A	4.375	2	7/27/2017	104.80	107.05	-	1.40	N	200,000	US82460EAD22
韓國電力(國有企業)	KOHNPW	A+/Aa3/AA-	4.750	2	7/13/2021	110.72	113.22	-	2.50	N	200,000	USY4899GAS22
新鴻基地產	SUNHUN	A+/A1/A	3.625	2	1/16/2023	99.83	102.55	-	3.26	N	200,000	XS0873639701
美國銀行	BAC	A-/Baa2/A	5.000	2	5/13/2021	111.42	113.42	-	2.64	N	65,000	BBG001P9WYR1
中國工商銀行	ICBCAS	A/A1/	4.875	2	12/7/2021	107.48	110.20	-	3.19	N	200,000	US0702140756
中油財務有限責任公司	CNPCCB	A+/A1/A+	3.125	2	4/28/2016	100.79	102.92	-	0.62	N	200,000	USG21895AA87
韓國天然氣	KORGAS	A+/Aa3/AA-	4.250	2	11/2/2020	108.19	110.69	-	2.24	N	100,000	US50066CAA71
馬來西亞國家石油公司	PETMK	A-/A1/A	7.875	2	5/22/2022	126.73	129.40	-	3.28	N	100,000	USY68856AB20
新加坡電信	STSP	A/NR/A	4.625	2	10/15/2019	107.78	110.26	-	2.28	N	100,000	XS045759838
中油財務有限責任公司	CNPCCB	A+/A1/A+	4.500	2	4/28/2021	106.13	108.72	-	2.94	N	200,000	USG21895AB60
中國銀行	BCHINA	A/A3/A-	5.550	2	2/11/2020	108.02	110.59	-	3.22	Y	100,000	USY1391CAJ00
美元債券--中風險(10年內到期,信評BBB-/Baa3以上)												
中國海外發展	CHIOLI	BBB+/Baa1/	3.950	2	11/15/2022	95.90	98.63	-	4.16	N	200,000	XS0852986156
大連萬達商業子公司	DALWAN	BBB-/Baa3/BBB+	4.875	2	11/21/2018	99.88	102.27	-	4.21	N	200,000	USX0989286850
金鷹商貿集團	GERGHK	BBB-/Baa3/BBB-	4.625	2	5/21/2023	83.98	87.27	-	6.66	N	200,000	USG3958RAB53
中信銀行(國際)有限公司	CINDBK	/Ba1/BBB-	6.875	2	6/24/2020	109.35	112.31	-	4.27	Y	100,000	US0520490672
印度電信服務公司	BHARTI	BBB-/Baa3/BBB-	5.125	2	3/11/2023	107.32	110.09	-	3.66	N	200,000	USN1384FAB32
美國環食餐廳Arcos Dorados	ARCO	/Ba3/BBB-	6.625	2	9/27/2023	96.33	99.49	-	6.70	N	100,000	USG0457FAD99
Braskem 西化工公司	BRASKM	BBB-/Baa3/BBB-	6.450	2	2/3/2024	97.44	100.51	-	6.37	N	200,000	US10553YAF25
C N 西鋼鐵	CSNABZ	BB+/Ba1/BBB+	6.875	2	9/21/2019	90.85	93.88	-	8.52	N	100,000	USG2583XAA93
Gerda 西鋼鐵	GGBRBZ	BBB-/Baa3/BBB-	5.893	2	4/29/2024	99.88	102.93	5.47	5.48	N	150,000	USG24422AA83
Itau 伊塔烏銀行	ITAU	/Baa3/BBB	5.125	2	5/13/2023	98.00	100.70	-	5.02	Y	200,000	US46556MAJ18
VOLVO 汽車	VLVY	BBB/Baa2/BBB	5.950	2	4/1/2015	99.52	101.55	-	-9.59	N	100,000	USW9880JNA34
俄羅斯Vnesheconombank銀行(國家持有)	VEBBNK	BB+/BBB-	6.025	2	7/5/2022	75.63	78.95	-	10.15	N	200,000	XS0800817073
俄羅斯VTB銀行	VTB	BB+/Baa3 /-/WD	6.465	2	3/4/2015	99.00	101.12	-	-36.68	N	100,000	XS0491998133
俄羅斯VTB銀行	VTB	/Baa3 /-/WD	6.000	2	4/12/2017	92.91	95.81	-	8.18	N	200,000	XS0772509484
俄羅斯鐵路	RURAIL	BB+/Baa3 /-/BBB-	5.700	2	4/5/2022	85.04	88.00	-	7.94	N	200,000	XS0764220017
深圳國際控股	SZHL	BBB-/Baa3/	4.375	2	4/20/2017	101.74	104.00	-	2.45	N	200,000	XS0767049371
兗州煤業	YZCOAL	BB+/Ba2/BBB+	5.730	2	5/16/2022	90.67	93.82	-	6.83	N	200,000	USY97279AB28
瑞士銀行	UBS	BBB/BBB+	7.250	1	2/22/2022	106.62	109.10	2.51	5.99	Y	200,000	XS0747231362
克羅埃西亞	CROATI	BB/Ba1/BB	6.250	2	4/27/2017	105.16	107.66	-	2.60	N	200,000	XS0776179656
巴林主權債(波斯灣)	BHRAIN	BBB-/BBB	6.125	2	7/5/2022	112.42	115.14	-	3.75	N	200,000	XS0794901727
印尼進出口銀行	BEIAI	BB+/Baa3/BBB-	3.750	2	4/26/2017	101.09	103.53	-	2.08	N	200,000	XS0776178419
JEFFERIES GROUP INC	JEF	BBB-/Baa3/BBB-	3.875	2	11/9/2015	100.25	102.25	-	0.66	N	65,000	BBG0018H86S9
印度石油和天然氣公司	ONGCIN	BBB-/Baa2/	3.750	2	5/7/2023	97.15	99.92	-	3.76	N	200,000	US0922882344
印度石油公司	IOCLIN	/Baa3/BBB-	5.750	2	8/1/2023	109.78	112.67	-	3.97	N	200,000	XS0955024236
印度石油公司	IOCLIN	/Baa3/BBB-	5.625	2	8/2/2021	109.06	111.90	-	3.54	N	200,000	XS0654493823
印度海外銀行	IOBIN	BB+/Baa3/	4.625	2	2/21/2018	102.28	104.69	-	2.97	N	200,000	XS0773015853
印度銀行	BOIN	BBB-/Baa3/	4.750	2	9/30/2015	100.87	102.98	-	-0.24	N	100,000	XS0498932721
印度工業信貸銀行(ICICI)	ICICI	BBB-/Baa2/	5.500	2	3/25/2015	99.33	101.36	-	-10.92	N	100,000	USM5314BAE13
印度AXIS銀行	AXSBIN	BBB-/Baa2/BBB-	5.125	2	9/5/2017	105.73	108.04	-	1.85	N	200,000	US05463EAB48
TNK-BP俄羅斯英國合資石油公司	TMENRU	BB+/Baa3 /-/WD	7.500	2	7/18/2016	99.48	102.38	-	5.70	N	100,000	XS0261906738
俄羅斯石油公司	LUKOIL	BBB-/Baa3 /-/BBB-	6.356	2	6/7/2017	100.26	103.26	-	4.83	N	100,000	XS0304273948
俄羅斯天然氣	GAZPRU	BB+/Baa3 /-/BBB-	4.950	2	7/19/2022	84.10	87.26	-	7.20	N	200,000	XS0805570354
俄羅斯天然氣	GAZPRU	BB+/Baa3 /-/BBB-	6.212	2	11/22/2016	99.65	102.37	-	4.77	N	100,000	XS0276456315
中國中鐵	CHRAIL	BBB+/BBB+	3.850	2	2/5/2023	99.63	102.36	-	3.51	N	200,000	XS0880288997
和福國際	LJHHK	/Baa3/BBB-	5.250	2	1/26/2017	103.92	106.19	-	1.95	N	200,000	XS0728761726
東亞銀行	BNKEA	A-/Baa3/	6.125	2	7/16/2020	110.50	113.25	-	3.41	Y	100,000	XS0521073428
華潤燃氣	CHIRE5	/Baa1/BBB+	4.500	2	4/5/2022	103.52	106.15	-	3.51	N	200,000	USG2113BA64
騰訊	TENCNT	A-/A3/	3.375	2	3/5/2018	101.75	104.06	-	1.99	N	200,000	USG87572AD85
北京控股	BEIENT	BBB+/A3/	4.500	2	4/25/2022	103.39	106.02	-	3.54	N	200,000	USG8669QAB61
來寶集團有限公司	NOBLSP	BBB-/Baa3/BBB-	6.750	2	1/29/2020	102.84	106.00	-	5.35	N	100,000	USG6542TAE13
來寶集團有限公司	NOBLSP	BBB-/Baa3/BBB-	6.625	2	8/5/2020	98.99	102.26	1.46	6.13	N	100,000	USG6542FAB79
越秀地產	YUEXIU	/Baa3/BBB-	4.500	2	1/24/2023	91.32	94.42	-	5.37	N	200,000	XS0878083517
中國海外發展	CHIOLI	BBB+/Baa1/	5.500	2	11/10/2020	106.50	109.02	-	3.73	N	100,000	XS0508012092
康師傅控股	TINGYI	BBB+/Baa1/	3.875	2	6/20/2017	102.10	104.38	-	1.93	N	200,000	XS0794621010
富邦金控	FUBON	BBB/	6.125	2	11/30/2020	109.78	112.72	-	3.66	Y	100,000	XS0561639211
國泰世華銀行	CATFIN	BBB+/Baa2/	5.500	2	10/5/2020	99.74	102.58	1.24	2.08	Y	100,000	us0231644427
PTTEP泰油勘產加拿大公司	PTTEPT	BBB+/Baa1/	5.692	2	4/5/2021	111.11	113.81	-	3.19	N	200,000	USC75088AA97
巴西石油公司	PETBRA	BBB-/Baa3 /-/BBB- /-/-	5.750	2	1/20/2020	93.10	95.93	-	6.74	N	65,000	US71645WAP68
PPT Global Chemical PCL	PTTGC	BBB/Baa2/	4.250	2	9/19/2022	101.06	103.78	-	3.67	N	200,000	usy7150waa37
VTB BANK	VTB	BB-/Ba2 /-/WD	6.950	2	10/17/2022	74.85	78.38	-	11.24	Y	200,000	XS0842078536
SBERRANK	SBERRU	/Ba1 /-/BB+	5.125	2	10/29/2022	79.04	82.55	-	8.23	Y	200,000	XS0848530977
中國東方資產	ORIEAS	BBB/AA-	4.750	2	9/19/2018	103.19	105.59	-	3.08	N	200,000	XS0963156350
印尼電力(印尼政府機構)	PLNI	BB/Baa3/BBB-	5.500	2	11/22/2021	107.09	109.61	-	3.87	N	200,000	US71568QAA58
VNESHECONOMBANK	VEBBNK	BB+/BBB-	6.025	2	7/5/2022	75.63	78.95	-	10.15	N	200,000	XS0800817073
俄羅斯農業銀行	RSHB	/NR/	8.500	2	10/16/2023	71.42	75.82	-	13.28	Y	200,000	XS0979891925
俄羅斯聯邦儲蓄銀行	SBERRU	//BB+	5.250	2	5/23/2023	70.13	73.67	-	10.01	Y	200,000	XS0935311240
BHARTI AIRTEL 有線電信服務	BHARTI	BBB-/Baa3/BBB-	5.350	2	5/20/2024	109.25	112.14	-	3.78	N	200,000	USN1384FAB15
美元債券--高風險(10年內到期,信評BBB-/Baa3以下)												
EMAAR中東房地產	EMAAR	BBB-/Ba1/	6.400	2	7/18/2019	112.75	115.44	-	2.66	N	200,000	XS0805885349
奧蘭國際	OLAMSP	//	6.000	2	10/15/2016	103.14	106.02	-	2.24	N	100,000	XS0450423321
奧蘭國際	OLAMSP	//	4.500	2	2/5/2020	99.29	102.11	-	4.02	N	200,000	XS1093915228
杜拜主權債	DUGB	//	6.450	2	5/2/2022	118.93	121.77	-	3.05	N	200,000	XS0778097674

美元債券參考報價表

2/23/2015

發行機構	Ticker	SP/Mdy's/ Fitch	票面利率	付息頻率	到期日	參考賣價 (%)	參考買價 (%)	買回收益 (%)	到期收益 (%)	次順位	最低交易面額	ISIN Code / BB
印尼輪胎	GJTLJ	B+/B2/	7.750	2	2/6/2018	95.76	98.75	13.17	8.23	N	200,000	USY71214AA14
印尼基建開發(Kawasan)	KJAJ	B+/B+	11.750	2	7/26/2017	106.76	109.83	2.04	7.24	N	200,000	USN4717BAB29
印尼地產開發商(Alam Sutera)	ASRIJ	B+/B1/	10.750	2	3/27/2017	104.67	107.50	-12.46	6.82	N	200,000	USY7126FAA13
INTEGR印尼煤炭公司	INDYJ	/B1/B+	7.000	2	5/7/2018	83.26	86.98	104.57	12.02	N	200,000	USN44515AA77
BUMI印尼煤炭公司	BUMIJ	D/Ca/	10.750	2	10/6/2017	26.79	32.44	35131.50	69.21	N	100,000	USY10048AA71
BUMI印尼煤炭公司	BUMIJ	D/Ca/	12.000	2	11/10/2016	26.91	32.69	2670.57	98.65	N	100,000	USY10038AA81
斯里蘭卡主權債	SRILAN	B+/B1/BB-	5.875	2	7/25/2022	100.40	103.28	-	5.33	N	200,000	USY2029SAH77
越南政府公債	VIETNM	BB-/B1/BB-	6.875	2	1/15/2016	103.18	105.99	-	0.13	N	100,000	XS0234072568
蒙古煤礦	MONMIN	CCC+/Caa2/	8.875	2	3/29/2017	66.50	70.43	513.00	28.59	N	200,000	USG6264VA001
中國山水水泥集團	SHASHU	B/BB	8.500	2	5/25/2016	100.57	103.43	17.72	5.60	N	200,000	USG2116MAA92
中國山水水泥集團	SHASHU	B/BB	10.500	2	4/27/2017	103.94	106.95	0.43	6.98	N	200,000	USG2116MAC58
中信泰富	CITPAC	BBB+/B+/A3/	6.875	2	1/21/2018	109.58	111.88	-	2.60	N	200,000	XS0758793342
中信泰富	CITPAC	BBB+/B+/A3/	6.625	2	4/15/2021	113.32	115.85	-	3.71	N	100,000	XS0611586263
中國東方	CHOGRP	/Caa1/BB-	8.000	2	8/18/2015	93.53	97.01	-	14.68	N	100,000	USG2108VAB74
中國東方	CHOGRP	/Caa1/BB-	7.000	2	11/17/2017	82.00	85.28	267.41	13.64	N	100,000	USG2108VAC57
中漁集團有限公司	CFGSP	B /B2/BB-	9.750	2	7/30/2019	81.85	86.57	24.48	13.91	N	200,000	USP25239AB34
亨德利	XINH	/Ba2/BB	6.250	2	1/29/2018	98.70	100.70	8.75	5.98	N	200,000	XS0875312364
中興集團	FUFENG	BB/BB-	7.625	2	4/13/2016	100.44	103.25	13.78	4.63	N	200,000	USG36844AB78
合景泰富	KWGPRO	B+/B1/	13.250	2	3/22/2017	104.71	107.72	-	9.08	N	200,000	XS0751939553
MI能源	MIEHOL	B/B	6.875	2	2/6/2018	67.00	69.00	56.69	21.63	N	200,000	XS0883317702
恒鼎實業	HIDIL	CCC-/Caa3/	8.625	2	11/4/2015	77.50	79.50	352.72	46.52	N	100,000	USG44403AB26
萬海航運	WANHAI	BB/Ba3/	5.500	2	6/29/2015	99.50	102.25	-	-1.00	N	65,000	xs0223450445
雅居樂地產	AGILE	B+/B1/	8.875	2	4/28/2017	97.59	100.52	55.64	8.80	N	100,000	USG01218AB54
雅居樂地產	AGILE	B+/B1/	9.875	2	3/20/2017	99.54	102.49	-	8.53	N	200,000	XS0756437132
恆大地產	EVERRE	B+/B2/	8.750	2	10/30/2018	91.73	94.59	14.88	10.56	N	200,000	USG3225AAD57
佳兆業集團	KAISAG	CC/Ca /+ /	10.250	2	1/8/2020	54.08	58.97	47.71	25.37	N	200,000	XS0871580477
世茂房地產控股公司	SHIMAO	BB-/Ba3/BB+	11.000	2	3/8/2018	105.00	107.00	-27.24	-27.24	N	200,000	XS0592717689
碧桂園	COGARD	BB+/Ba2/	10.500	2	8/11/2015	101.99	104.51	-	0.69	N	100,000	XS0531782273
碧桂園	COGARD	BB+/Ba2/	11.125	2	2/23/2018	104.33	106.67	-2.43	8.55	N	200,000	USG24524AF02
碧桂園	COGARD	BB+/Ba2/	7.500	2	1/10/2023	93.57	96.47	10.10	8.11	N	200,000	USG24524AG84
SOHO中國	SOHOCH	BB+/Ba1/	7.125	2	11/7/2022	98.04	100.99	7.91	6.95	N	200,000	XS0851996925
金地集團	GEMDAL	B+/Ba3/	7.125	2	11/16/2017	99.68	102.51	8.33	6.11	N	200,000	XS0854399952
白俄羅斯主權債	BLERUS	B-/B3/	8.750	2	8/3/2015	95.00	98.00	-	13.50	N	100,000	XS0529394701
巴西BMG銀行	BCOBMG	/B1/	9.625	2	3/27/2017	102.66	106.06	-	6.47	N	200,000	XS0758798143
巴西BMG銀行	BCOBMG	/B2/CCC	8.875	2	8/5/2020	94.49	97.71	-	9.42	Y	100,000	USP07785AE11
巴拉圭主權債	PARGUY	BB/Ba2/BB	4.625	2	1/25/2023	102.04	105.04	-	3.88	N	200,000	USP75744AA38
泛美能源	PANAME	/B2/B	7.875	2	5/7/2021	102.33	105.87	-	6.70	N	65,000	us69783uaa97
墨西哥基礎建設Empresas ICA	ICASA	B/B2/	8.900	2	2/4/2021	72.91	77.03	45.93	14.85	N	65,000	USP37149AN42
西麥斯水泥集團	CEMEX	B+/BB-	9.250	2	5/12/2020	104.48	106.48	0.42	7.71	N	70,000	USE28087AA77
莫斯科銀行	BKMOSC	/Ba3 /B-/WD	5.967	2	11/25/2015	96.03	99.47	-	6.68	Y	100,000	XS0236336045
莫斯科銀行	BKMOSC	/Ba1 /B-/WD	6.699	2	3/11/2015	99.00	101.24	-	-20.41	N	100,000	XS0494095754
烏克蘭主權債	UKRAIN	CCC-/Caa3/CC	6.875	2	9/23/2015	47.13	50.94	-	170.59	N	100,000	XS0453783434
烏克蘭主權債	UKRAIN	CCC-/Caa3/CC	9.250	2	7/24/2017	43.06	46.54	-	49.54	N	200,000	XS0808758196
烏克蘭農產品	MRIYA	NR/WD	9.450	2	4/19/2018	9.00	13.99	-	106.53	N	200,000	XS0916902256
烏克蘭農產品	MRIYA	NR/WD	10.950	2	3/30/2016	10.00	12.00	-	373.67	N	200,000	XS0559140875
烏克蘭畜牧	MHPESA	/Caa2/CCC	10.250	2	4/29/2015	92.00	96.00	-	33.36	N	100,000	USL36366MAB92
烏克蘭DTEK煤炭產業	DTEKUA	/Caa3/CCC	9.500	2	4/28/2015	60.00	62.00	-	353.45	N	100,000	USN2800PA59
塔塔電力有限公司	TPWRIN	B+/Ba3/	8.500	2	8/19/2017	107.50	110.88	-	3.86	N	65,000	USY85479AB21
庫丹塔資源	VEDLN	BB /B-/Ba3/WD	9.500	2	7/18/2018	99.73	102.90	-	8.49	N	100,000	USG9328DAD24
庫丹塔資源	VEDLN	BB /B-/Ba3/WD	8.250	2	6/7/2021	94.78	98.19	-	8.62	N	200,000	USG9328DAG54
庫丹塔資源	VEDLN	BB /B-/	5.500	2	7/13/2016	91.75	93.75	-	10.46	N	100,000	XS0434722087
庫丹塔資源	VEDLN	BB /B-/Ba3/WD	7.125	2	5/31/2023	88.06	91.49	-	8.58	N	200,000	USG9328DAJ93
祿魯漁業	PESEXA	B+/B2/	7.375	2	1/31/2020	76.25	81.00	21.56	12.67	N	200,000	USP7744AAA45
阿根廷地方債	BUENOS	CCC-/Caa2/	10.875	2	1/26/2021	98.50	101.66	-	10.49	N	100,000	XS0584493349
阿根廷主權債	ARGENT	/WD	8.750	2	6/2/2017	97.09	100.21	-	7.53	N	65,000	XS0501195480
委內瑞拉主權債	VENZ	CCC/Caa3/CCC	8.250	2	10/13/2024	35.92	38.84	-	25.60	N	65,000	USP97475AP55
委內瑞拉主權債	VENZ	CCC/Caa3/CCC	9.250	2	5/7/2028	37.85	41.50	-	24.03	N	65,000	USP17625AB33
委內瑞拉主權債	VENZ	CCC/Caa3/CCC	7.000	2	12/1/2018	39.00	42.00	-	36.49	N	65,000	USP97475AD26
委內瑞拉主權債	VENZ	CCC/Caa3/CCC	5.750	2	2/26/2016	73.13	76.13	-	36.31	N	65,000	USP97475AF73
委內瑞拉石油	PDVSA	CCC/CCC	5.375	2	4/12/2027	30.40	33.50	-	20.30	N	65,000	XS0294364954
委內瑞拉石油	PDVSA	/CCC	12.750	2	2/17/2022	49.62	52.86	-	28.76	N	65,000	USP7807HAM71
委內瑞拉石油	PDVSA	CCC/CCC	8.500	2	11/2/2017	62.59	65.44	-	27.51	N	65,000	USP7807HAK16
委內瑞拉石油	PDVSA	CCC/CCC	9.000	2	11/17/2021	37.58	40.55	-	30.04	N	65,000	USP7807HAP03
委內瑞拉石油	PDVSA	/CCC	5.000	2	10/28/2015	88.79	92.18	-	17.76	N	65,000	XS0460546525
委內瑞拉電力公司	ELECAR	CCC/CCC	8.500	2	4/10/2018	35.75	42.16	-	44.40	N	65,000	XS0356521160
祿魯農產品(CAMPOSOL)	CSOLNO	B/B3/B	9.875	2	2/2/2017	98.28	101.51	51.30	9.00	N	65,000	USP19189AA04
俄羅斯標準銀行	RUSB	B-/B3/	7.561	2	12/1/2016	50.00	52.00	-	52.29	Y	100,000	XS0275728557
巴西肉品加工	MRFBZ	B+/B2/B+	9.625	2	11/16/2016	100.50	104.02	-	7.09	N	65,000	USG5814RAA61
巴西肉品加工	MRFBZ	B+/B2/B+	9.500	2	5/4/2020	95.01	97.95	45.07	10.01	N	100,000	USG5814RAB45
JBS	JBSSBZ	BB/Ba3/BB	7.250	2	6/1/2021	102.87	105.89	5.14	6.10	N	65,000	USU0901CAC48
白俄羅斯主權債	BLERUS	B-/B3/	8.950	2	1/26/2018	80.98	84.43	-	15.80	N	100,000	xs0583616239
佳兆業集團	KAISAG	CC/Ca /+ /	10.250	2	1/8/2020	54.08	58.97	47.71	25.37	N	200,000	XS0871580477
印尼電訊(無配息)	BTELJ	D/WD	11.500	2	5/7/2015	6.00	10.00	11529.31	4563.38	N	100,000	USY05509AA57
墨西哥紙業	PAPPEL	/B	10.000	4	8/27/2016	98.00	102.00	-14.35	8.57	N	65,000	USP7448MAH27
阿根廷機場	AEROA	CCC-/Caa1/	10.750	4	12/1/2020	103.00	106.38	13.15	8.15	N	65,000	USP0092MAD58
復星國際子公司	FOSONI	BB/B1/	6.875	2	1/30/2020	99.23	102.19	7.32	6.35	N	200,000	XS0878012334
烏克蘭雞蛋	AVINPU	/CC	10.000	2	10/29/2015	48.50	55.50	-	124.38	N	100,000	XS0553088708
克萊銀行	BACR	BB+/NR/BBB-	7.625	2	11/21/2022	113.06	115.06	-	5.23	Y	200,000	USO6740L8C27
烏克蘭鐵路	RAILUA	CCC/CC	9.500	2	5/21/2018	34.00	41.01	-	46.31	N	200,000	XS0934134312
蒂投資公司	BHITIJ	BB-/B2/	5.875	2	5/16/2018	79.46	82.73	25.33	12.55	N	200,000	USY6589AAA44
安東油田服務	ANTOIL	/Ba3/BB-	7.500	2	11/6/2018	70.85	75.61	28.45	16.58	N	200,000	USG03999AA07
富力地產	GZFRFP	B+/B1/BB	8.500	2	1/10/2019	93.73	96.66	12.62	9.55	N	200,000	XSI009853141
寶龍地產	PWRLNG	B-/B3/	11.250	2	1/25/2018	94.84	99.03	18.32	11.64	N	200,000	XS0875844960

美元債券參考報價表

2/23/2015

發行機構	Ticker	SP/Mdy's/ Fitch	票面利率	付息頻率	到期日	參考賣價(%)	參考買價(%)	買回收益(%)	到期收益(%)	次順位	最低交易面額	ISIN Code / BB
印尼紡織	SRIRJK	BB-/B1/	9.000	2	4/24/2019	96.19	99.16	11.33	9.24	N	200,000	USY2749KAA89
印尼Cikarang Listrindo電力公司	CIKLIS	BB-/Ba2/	6.950	2	2/21/2019	104.40	107.36	2.82	4.89	N	200,000	USN5276YAC05
印尼Indosat電信服務公司	ISATIJ	BB+/Ba1/BBB	7.375	2	7/29/2020	104.87	106.87	-0.11	5.88	N	100,000	USN44519AA99
印尼Japfa食品	JPFAUJ	BB-/BB-	6.000	2	5/2/2018	91.71	94.84	13.26	7.86	N	200,000	USN21177AA33
力寶不動產	LPKRJJ	BB-/Ba3/BB-	7.000	2	4/11/2022	102.64	105.46	6.08	6.04	N	200,000	XS1054375446
印尼Modernland不動產	MDLNJJ	B/B2/B	11.000	2	10/25/2016	101.26	104.31	-	8.16	N	200,000	USY6141TAA44
印尼電腦服務	MLPL	B+/B+	9.750	2	7/25/2018	104.98	107.93	7.09	7.09	N	200,000	XS0955613228
印尼星能電力公司	STAREN	/B2/B+	6.125	2	3/27/2020	99.58	102.67	6.14	5.51	N	200,000	USG84393AB65
印尼TBC環球電信公司	TBIGJJ	BB/Ba3/BB	4.625	2	4/3/2018	99.77	102.56	4.29	3.74	N	200,000	USY85516AA35
雅居樂地產	AGILE	B+/B1/	8.875	2	4/28/2017	97.59	100.52	55.64	8.60	N	100,000	USG01218AB54
ALPHA STAR HOLDING LTD	DAMACR	BB//	4.970	2	4/9/2019	87.67	90.63	-	7.66	N	200,000	XS1054932154
GEORGIAN 鐵路	GRAIL	BB-/BB-	7.750	2	7/11/2022	106.63	109.87	-	6.07	N	200,000	XS0800346362
中國宏橋	HONGQI	BB/BB	7.625	2	6/26/2017	99.50	102.42	-	6.49	N	200,000	XS1081333921
綠城中國	GRNCH	B+/B2/	8.500	2	2/4/2018	99.55	102.48	10.08	7.54	N	200,000	XS0883317884
ROLTA LLC	RLTAIN	BB-/BB-	10.750	2	5/16/2018	100.10	103.92	11.42	9.30	N	200,000	USU77587AA83
ROLTA LLC	RLTAIN	BB-/BB-	8.875	2	7/24/2019	95.80	99.42	10.81	9.03	N	200,000	USU77583AA79
阿根廷乳品	MASHER	CCC-/CCC	12.625	2	7/3/2021	92.33	96.44	15.52	13.47	N	1	USP6460MAJ38
宏華集團	HONHUA	/B2/BB	7.450	2	9/25/2019	59.04	64.05	29.30	19.72	N	200,000	USG4584RAA70
VEB	VEBNNK	BB+//BBB-	6.902	2	7/9/2020	83.86	86.97	-	10.10	N	100,000	XS0524610812
美元債券--中風險(10年以上到期，信評BBB/Baa2以上)												
印度信實工業有限公司	RILN	BBB+/Baa2/	5.875	2	2/28/2049	98.66	101.65	5.26	5.76	N	200,000	USY72596BT83
泰國PTT石油與天然氣	PTTBT	BBB+/Baa1/	4.500	2	10/25/2042	88.39	91.62	-	5.07	N	200,000	USY71548BT60
泰國石油	TOPTB	BBB/Baa1/	4.875	2	1/23/2043	92.59	96.16	-	5.14	N	200,000	USY8620BAQ42
法國電力公司	EDF	BBB+/A3/A-	5.250	2	1/29/2049	103.98	106.68	4.25	5.24	Y	100,000	USF2093TAF33
安聯集團	ALVGR	A+/A2/A	5.500	2	11/28/2049	106.45	109.07	2.82	4.95	Y	200,000	XS0857872500
淡馬錫控股	TEMASE	AAA/Aaa/	3.375	2	7/23/2042	90.96	94.11	-	3.72	N	250,000	USR7973RAD26
德國萊茵集團	RWE	BBB-/Baa3/BBB-	7.000	2	10/12/2072	106.85	109.34	3.26	6.77	Y	65,000	XS0767140022
英國瓦斯集團	BGGRR	BBB /*-/Baa1/BBB	6.500	2	11/30/2072	106.21	108.77	3.15	6.49	Y	200,000	USF0798324306
法國巴黎銀行	BNP	BB+/Ba1/BBB	7.195	2	6/29/2049	118.13	120.13	5.60	4.94	Y	100,000	USF1058YHX97
法國巴黎銀行	BNP	BB+/Ba1/BBB	6.500	4	6/29/2049	100.81	102.81	-3.42	6.30	Y	65,000	FR0010477125
法國農業信貸銀行	ACAFB	BB+/Ba2/BBB-	7.000	4	1/29/2049	100.77	102.77	-8.08	6.79	Y	65,000	XS0161441000
英國 誠人壽	PRUFIN	A-/Baa1/BBB+	6.500	4	6/29/2049	100.26	102.38	-0.74	6.33	Y	65,000	XS0170488992
渣打銀行	STANLN	BB+/Baa2/BBB	7.014	2	7/29/2049	109.97	113.07	5.95	5.27	Y	100,000	USR833254AC43
永亨銀行	WINHAN	/A2/BBB+	6.000	2	4/29/2049	103.47	106.23	2.99	2.20	Y	100,000	XS0296645012
中國中化集團	SINOC	A-/A3/A-	6.300	2	11/12/2040	121.61	126.52	-	4.54	N	100,000	USG8185TAB55
中國信託 (香港)	CHIFIN	BBB-/Baa3/BBB	5.625	2	3/29/2049	98.64	101.33	-	2.20	Y	65,000	XS0215262402
巴克萊銀行	BACR	BB/Ba1/BBB-	7.434	2	9/29/2049	109.72	112.54	2.76	3.35	Y	100,000	XS0322792010
蘇黎世再 險集團	ZURNVX	A/A3/	8.250	4	1/18/2049	113.74	116.49	2.35	7.32	Y	100,000	XS0733071632
國衛 險	AXASA	BBB-/Baa1/BBB	6.379	2	12/29/2049	110.03	112.87	5.37	4.83	Y	100,000	USF0609NAQ19
荷蘭合作銀行	RABOBK	//BBB	8.400	2	11/29/2049	109.98	112.54	2.83	7.91	Y	100,000	XS0703303262
荷蘭合作銀行	RABOBK	//BBB	8.375	2	7/29/2049	106.68	109.27	1.74	7.33	Y	100,000	XS0583302996
SSE美國公共事業	SSELN	BBB/Baa2/BBB	5.625	2	9/29/2049	104.34	106.78	2.90	5.94	Y	200,000	XS0829351690
俄羅斯主權債	RUSIA	BB+/Ba1/BBB-	5.625	2	4/4/2042	85.19	88.38	-	6.55	N	200,000	USG076473852
WANDA PROPERTIES	DALWAN	BBB-/Baa3/BBB+	7.250	2	1/29/2024	106.83	109.64	-	5.85	N	200,000	XS1023280271
俄羅斯天然氣集團透過Gaz Capital	GAZPRU	BB+/Baa3 /*-/BBB-	7.288	2	8/16/2037	92.82	96.24	-	7.64	N	100,000	XS0316524130
俄羅斯天然氣集團透過Gaz Capital	GAZPRU	BB+/Baa3 /*-/BBB-	8.625	2	4/28/2034	103.64	107.01	-	7.91	N	10,000	XS0191754729
匯豐控股	HSBC	/Baa3/BBB	6.375	2	12/29/2049	102.06	104.64	5.74	5.57	Y	200,000	US404280AS86
美元債券--高風險(10年以上到期，信評BBB/Baa2以下)												
西石油天然氣服務商	OOGCOR	BB+//	7.000	4	12/29/2049	53.46	57.06	15.92	12.13	N	200,000	USG6712EAA67
來寶集團有限公司	NOBLSP	//	6.000	2	6/24/2049	87.26	90.83	8.58	6.69	Y	200,000	XS1079076029
菲律賓Petron石油化工	PCORPM	//	7.500	2	2/6/2049	102.51	105.29	5.78	9.29	Y	200,000	XS0879849312
西國民鋼鐵公司	CSNABZ	BB+/Ba1/BB+	7.000	4	9/29/2049	67.60	71.65	71.24	9.91	N	100,000	USG2585XAA75
哈薩克國家鐵路	KTZKZ	BBB-/Baa3/BBB	6.950	2	7/10/2042	91.45	94.77	-	7.40	N	200,000	US0799658637
瑞士再 險	SRENVX	/NR/	8.250	1	9/29/2049	110.79	113.44	4.06	7.20	Y	200,000	XS0765564827
VTB Bank Perp	VTB	/NR/	9.500	2	12/29/2049	72.21	75.94	14.80	12.90	Y	200,000	XS0810596832
阿布達比伊斯蘭銀行	ADIBUH	//	6.375	2	10/29/2049	102.66	105.59	4.69	6.66	Y	200,000	XS0851081660
巴西材料商(Magnesita)	MAGGBZ	BB/BB	8.625	4	4/29/2049	84.05	87.86	15.48	9.87	N	200,000	USG57768TAA81
麥格里集團	MQGAU	BB/Ba1/BB	8.375	2	12/29/2049	103.15	105.15	1.61	7.94	Y	100,000	XS0562354422
印尼主權債	INDON	BB+/Baa3/BBB-	6.625	2	2/17/2037	120.45	123.32	-	4.88	N	100,000	USY20721AJ83
印尼主權債	INDON	BB+/Baa3/BBB-	5.250	2	1/17/2042	102.78	105.48	-	4.88	N	200,000	USY20721BB49
高盛集團	GS	BB/Ba2/BB+	4.000	4	12/29/2049	76.40	78.40	436.18	5.10	Y	65,000	US381427AA15
華潤電力	RESOPW	BB/Ba2/	7.250	2	5/9/2049	102.25	105.01	2.98	6.52	Y	200,000	XS0622491701
瑞士信貸集團	CS	//BBB-	7.875	2	2/24/2041	104.59	107.00	3.06	6.51	Y	100,000	XS0595225318
來寶集團有限公司	NOBLSP	/NR/	8.500	2	11/29/2049	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	Y	100,000	XS0552553850
Cosan(巴西的糖廠)	CSANBZ	BB/Ba2/BB+	8.250	4	11/29/2049	91.69	96.23	14.03	8.59	N	100,000	XS0556373347
長江基建集團	CKINF	//	6.625	2	9/29/2049	100.73	103.24	1.14	6.39	Y	100,000	XS0543477821
東亞銀行	BNKEA	BB/Ba3/	8.500	2	11/29/2049	114.48	116.48	4.56	6.70	Y	100,000	XS0462883603
印度ICICI銀行	ICICI	BB/Ba3/	7.250	2	8/29/2049	100.58	103.42	5.09	3.47	Y	200,000	USY38575CZ07
巴西銀行	BANBRA	BB-//	9.250	2	10/29/2049	90.39	93.43	10.46	10.02	Y	200,000	USP3772WAC66
巴西銀行	BANBRA	/Ba1/	8.500	2	10/29/2049	107.25	109.25	6.51	8.51	Y	100,000	USP3772WAA01
東京三菱金融集團	MUFJ	BBB/Ba1/BBB-	6.346	2	7/29/2049	104.53	107.02	1.32	2.37	Y	100,000	USG63255AA42
烏日金融控股	WOORIB	BB/Ba2/BB-	6.208	2	5/2/2067	105.83	108.60	2.16	2.29	Y	100,000	USY9695NBR36
法國興業銀行	SOCGEN	BB+/Ba2/BB+	5.922	2	4/29/2049	102.26	104.26	3.80	2.17	Y	100,000	USF8586CAA02
法國巴黎銀行	BCEGPF	BB+/Ba2/BBB-	6.750	4	1/29/2049	100.00	102.00	-4.74	6.60	Y	65,000	FR0010279208
Natixis銀行	KNFP	BB+/Ba2/BBB-	10.000	2	4/29/2049	116.00	118.00	3.92	6.19	Y	100,000	USF6483LHM57
德國北方銀行(2010年起暫停配息)	HSBN	/C/a/	8.000	4	12/29/2049	28.22	31.68	559.60	26.26	Y	65,000	XS0159207850
Gazprom Bank	GPRBU	/NR/	7.875	2	4/29/2049	77.03	81.23	15.60	10.50	Y	200,000	XS0848137708
KBC Bank	KBC	BBB-/NR/	8.000	2	1/25/2023	111.21	113.89	2.99	6.23	Y	200,000	BE6248510610
BANCO DO BRASIL	BANBRA	BB-//	6.250	2	10/29/2049	70.60	73.54	10.89	8.82	Y	200,000	USG07402DP58
杜拜伊斯蘭銀行	DIBUH	//	6.250	2	3/29/2049	101.69	104.63	4.98	6.36	Y	200,000	XS0902330769
La Mondiale	LAMON	BBB-//	7.625	2	4/29/2049	109.40	112.13	4.40	7.24	Y	200,000	XS0919401751
中信泰富	CITPAZ	//	8.625	2	5/29/2049	114.17	116.83	3.76	7.79	Y	200,000	XS0933855354

美元債券參考報價表

2/23/2015

發行機構	Ticker	SP/Mdy's/ Fitch	票面利率	付息頻率	到期日	參考賣價 (%)	參考買價 (%)	買回收益 (%)	到期收益 (%)	次順位	最低交易面額	ISIN Code / BB
印尼政府主權債	INDON	BB+/Baa3/BBB-	5.250	2	1/17/2042	102.78	105.48	-	4.88	N	200,000	USY20721BB49
印尼政府主權債	INDON	BB+/Baa3/BBB-	5.875	2	1/15/2024	114.61	117.13	-	3.60	N	200,000	USY20721BJ74
瑞安房地產有限公司	SHUION	//	10.125	2	12/10/2049	97.48	100.47	9.91	12.85	N	200,000	XS0855853718
蘇格蘭皇家銀行	RBS	B+/B2/B+	7.640	2	3/29/2049	107.00	109.00	3.95	2.75	Y	100,000	US780097AU54
阿聯酋銀行	EBIUH	//	5.750	2	5/29/2049	97.14	100.01	5.74	6.23	Y	200,000	XS0935833292
中信銀行(國際)有限公司	CINDBK	/Ba3/	7.250	2	4/29/2049	104.96	107.89	5.12	6.75	Y	200,000	XS1055321993
西銀行	BANBRA	BB-/Ba2/	9.000	2	5/4788.00	84.65	87.69	11.15	10.09	Y	200,000	USP3772WAF97
龍湖地產	LNGFOR	BB/Ba2/	6.750	2	5/4789.00	93.88	96.84	9.03	7.28	N	200,000	XS0877742105

人民幣離岸債券(CNH)參考報價表

2/23/2015

發行機構	Ticker	SP/Mdy's/ Fitch	票面利率	付息頻率	到期日	參考實價(%)	YTM_實價(%)	參考實價(%)	到期收益(%)	次順位	掛牌交易所	ISIN Code / BB
離岸人民幣債券--投資等級												
恒信金融集團子公司	HAISEC	BBB/AAA(中誠信)	5.800	2	5/30/2017	98.58	6.48	101.13	5.26	N	HONG KONG	HK0000201548
中國環球租賃子公司	GENERT	AAA(上海新 界)	5.700	4	1/30/2017	97.00	7.38	99.55	5.95	N	HONG KONG	HK0000182722
五礦集團	MINMET	AAA(中誠信)	4.250	2	6/16/2017	97.90	5.23	100.58	3.98	N	HONG KONG	HK0000203353
中航國際租賃	CATIC	BBB+Baa3/BBB	4.800	2	4/10/2017	98.34	5.64	100.78	4.41	N	HONG KONG	HK0000193976
中國平安子公司	PINGIN	//	4.750	2	11/4/2018	99.16	5.00	101.91	4.19	N	SGX-ST	HK0000170461
中航國際租賃子公司	AVICIL	Baa3/BBB	4.375	2	6/13/2017	99.00	4.84	101.38	3.74	N	HONG KONG	HK0000202710
中國外運子公司	SINOTR	AAA(上海新 界實信評估)	4.500	2	6/10/2017	96.35	6.24	99.29	4.83	N	HONG KONG	HK0000202736
北京汽車子公司	MAIKUN	AAA(大公國際實信評估)	4.500	2	6/6/2017	96.05	6.39	98.95	4.99	N	HONG KONG	HK0000202389
坤智(北大方正子公司)	PKFOUN	AA+(聯合)	5.875	2	1/15/2017	92.50	10.34	95.75	8.35	N	HONG KONG	HK0000181369
東航海外香港公司	CHIEAS	AAA(大公國際)	4.800	2	3/13/2017	98.28	5.70	101.08	4.24	N	HONG KONG	HK0000190410
中國電力國際發展	CHIPOW	AAA(中誠信)/AAA(大公國際)	3.200	2	12/23/2015	97.31	6.62	99.87	3.36	N	NOT LISTED	HK0000073376
中國聯通	CNUCOM	AAA(中誠信)	4.000	2	4/16/2017	97.18	5.41	99.87	4.06	N	HONG KONG	HK0000196235
招商銀行	CHINAM	BBB+Baa3/BBB	4.100	2	4/10/2017	97.98	5.11	100.44	3.88	N	HONG KONG	HK0000195088
綠地香港	GRNLHK	//BBB-	5.500	2	1/23/2018	95.27	7.33	97.64	6.40	N	HONG KONG	XS1020462930
俄羅斯天然氣銀行	GPBRU	BB+/Ba1 /B-/BB+	4.250	2	1/30/2017	83.38	14.41	88.00	11.34	N	DUBLIN	XS1026025103
俄羅斯天然氣銀行	GPBRU	BB+/Ba1 /B-/BB+	4.000	2	2/24/2016	89.25	16.09	93.63	10.92	N	DUBLIN	XS0888100319
巴西BTG銀行	BTGPBG	/Baa3/BBB-	4.100	2	3/26/2016	95.76	8.24	98.85	5.19	N	STUTTGART	XS0907930399
遠東宏信(金融租賃)	FRSHK	BBB-//	5.450	2	12/11/2016	98.95	6.07	101.50	4.57	N	HONG KONG	HK0000176187
萬科子公司Bestgain	VANKE	BBB/Baa3/BBB+	4.500	2	12/4/2018	96.83	5.44	99.46	4.65	N	HONG KONG	HK0000175114
萬科子公司Bestgain	VANKE	BBB/Baa3/BBB+	4.050	2	12/16/2016	96.87	5.90	99.56	4.30	N	HONG KONG	HK0000176583
來寶集團	NOBLSP	BBB-//	4.000	2	1/30/2016	96.33	8.18	99.09	5.01	N	SGX-ST	XS0880258651
印度道路建設(IL&FS)	ILFSIN	//BBB-	5.750	2	4/26/2015	98.27	16.69	101.04	-0.55	N	HONG KONG	BBG002WC4Q92
阿爾斯通	ALOFP	BBB-/Baa3/	4.250	2	3/9/2015	98.69	48.67	101.05	-25.15	N	BERLIN	FR0011215359
東亞銀行(中國)	BNKEA	A//	3.650	2	5/11/2015	98.56	10.98	100.88	-0.69	N	HONG KONG	HK0000110798
法國興業銀行	SOCGEN	A/A2/A	5.000	2	4/19/2015	99.00	12.05	101.24	-3.42	N	LUXEMBOURG	XS0679584978
大眾汽車國際金融	VW	A/A3/A	2.150	2	5/23/2016	96.34	5.23	98.93	3.03	N	SIX	XS0628626222
中國農業發展銀行	ADBCH	AA-/NR/	3.350	2	6/22/2017	97.29	4.59	100.04	3.33	N	HONG KONG	HK0000115730
BSH BOSCH UND SIEMENS HA	BSHBOS	A//	3.375	2	9/28/2016	97.59	4.96	100.20	3.25	N	DUSSELDORF	XS0683641756
普洛斯(不動產經營/開發)	GLPSP	/Baa2/BBB+	3.375	2	5/11/2016	97.08	5.91	99.52	3.78	N	SGX-ST	HK0000079803
國家開發銀行	SDBC	AA-/NR/	3.450	2	1/16/2017	97.82	4.67	100.54	3.15	N	HONG KONG	HK0000098357
中國農業發展銀行	ADBCH	AA-/NR/	3.500	2	1/17/2017	97.76	4.75	100.43	3.26	N	HONG KONG	EI9563012
AMERICA MOVIL SAB DE CV	AMXLMM	NR/WR/NR	3.500	2	2/8/2015	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	N	EUROMTF	XS0731597505
三菱日聯租賃有限公司	DIALEA	/A3/	3.600	2	3/2/2015	98.47	153.29	100.49	-28.93	N	NOT LISTED	XS0752242650
三菱日聯租賃有限公司	BSBG	A-/A3/A-	3.675	2	3/1/2015	98.84	143.38	101.03	-71.19	N	HONG KONG	HK0000103934
華潤電力	RESOPW	BBB-/Baa3/	3.750	2	8/3/2015	99.77	4.27	101.87	-0.50	N	HONG KONG	XS0528404733
HITACHI CAPITAL CORP	HITCAP	A-//	3.750	2	3/22/2015	98.88	20.01	101.00	-10.57	N	NOT LISTED	XS0758311376
AIR LIQUIDE FINANCE	AIFP	A+//	3.950	2	9/19/2018	98.38	4.45	101.32	3.55	N	LUXEMBOURG	HK0000088853
工商銀行亞洲	ICBCAS	A//	3.750	2	11/19/2018	97.65	4.44	100.42	3.63	N	WARSAW	XS0994976701
工商銀行亞洲	ICBCAS	A//	3.350	2	11/19/2016	97.61	4.80	100.03	3.33	N	NOT LISTED	XS0991742346
LOTTE SHOPPING BUS MGMT	LOTTES	/WR/NR	4.000	2	2/9/2015	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	N	SGX-ST	HK0000101086
上海寶鋼集團	SBGS	A-/A3/A-	4.150	2	3/1/2017	98.09	5.16	100.83	3.72	N	HONG KONG	HK0000103942
國家開發銀行	SDBC	AA-/NR/	4.200	2	1/19/2027	98.65	4.35	101.46	4.04	N	HONG KONG	EI9611951
阿爾斯通	ALOFP	BBB-/Baa3/	4.250	2	3/9/2015	98.69	48.67	101.05	-25.15	N	BERLIN	FR0011215359
三井物產	MTSCO	A+/A2/	4.250	2	3/1/2017	98.88	4.84	101.75	3.34	N	LONDON	XS0750695883
上海寶鋼集團	SBGS	A-/A3/A-	4.375	2	12/1/2016	98.87	5.05	101.36	3.57	N	HONG KONG	HK0000094968
中銀航空租賃	BOCAVI	BBB- /B+/A-	4.500	2	11/20/2018	98.00	5.09	100.50	4.35	N	SGX-ST	XS0994732401
EMIRATES NBD PJSC	EBIUH	/Baa1/A+	4.875	2	3/12/2015	98.80	33.73	101.07	-20.53	N	LUXEMBOURG	XS0755916672
工銀亞洲	ICBCAS	//BBB+	6.000	2	11/4/2021	100.07	5.98	102.97	5.46	Y	SGX-ST	HK0000091832
中國銀行(新加坡)	BCHNA	/A1/A	3.300	2	3/4/2016	97.96	5.38	100.29	3.01	N	SGX-ST	XS1038613730
中國銀行(新加坡)	BCHNA	/A1/A	4.000	2	3/4/2019	99.09	4.25	101.68	3.55	N	SGX-ST	XS1038613904
中化資本離岸有限公司	SINOCB	A-/A3/A-	3.550	2	5/13/2017	97.00	4.99	99.45	3.81	N	HONG KONG	HK0000199114
俄羅斯農業銀行	RSBH	/Ba1 /B-/BB+	3.600	2	2/4/2016	89.63	15.91	93.75	10.76	N	DUBLIN	HK0000138237
離岸人民幣債券--高收益												
華夏銀行	HUAXIA	//	4.950	2	6/30/2017	97.98	5.88	100.74	4.61	N	HONG KONG	HK0000205036
首創置業子公司	BICAPT	/Ba3/BB	6.875	2	2/17/2019	98.50	7.32	101.63	6.40	N	HONG KONG	HK0000185824
蒙古交易發展銀行	TDBM	/B3/	10.000	2	1/21/2017	93.38	14.05	96.88	11.86	N	SGX-ST	XS1013890220
俄羅斯標準銀行	RUSB	NR/WR/NR	8.000	2	2/14/2015	95.63	#N/A N/A	100.75	#N/A N/A	N	DUBLIN	XS0886631281
福特汽車公司	F	BBB-//BBB-	4.875	2	3/26/2015	98.83	20.18	101.15	-9.06	N	DUSSELDORF	XS0717183015
居樂地產	AGILE	B+/B1/	6.500	2	2/28/2017	90.25	12.11	93.00	10.45	N	HONG KONG	XS1038308695
恒大地產集團	EVERRE	B+/B2/	9.250	2	1/19/2016	96.18	13.88	98.93	10.51	N	SGX-ST	XS0576382492
金地集團(不動產經營/開發)	GEMDAL	B+/Ba3/	9.150	2	7/26/2015	99.25	11.01	101.75	4.81	N	SGX-ST	BBG00036Y4T13
中駿置業(不動產經營/開發)	CHINSC	B-/B2/	10.500	2	1/14/2016	96.20	15.22	99.05	11.63	N	SGX-ST	USG21189AA66
金地集團	GEMDAL	B+/Ba3/	5.625	2	3/21/2018	91.63	8.80	94.75	7.57	N	SGX-ST	XS0905629084
新城發展控股	FUTLAN	B+/B1/B+	9.750	2	4/23/2016	93.75	15.81	96.63	12.94	N	SGX-ST	HK0000147014
首創置業子公司	BICAPT	/Ba3/BB	7.600	2	11/29/2015	99.25	8.61	101.75	5.20	N	HONG KONG	HK0000131141
佳兆業集團	KAISAG	CCu//	6.875	2	4/22/2016	58.88	61.61	63.25	53.42	N	SGX-ST	HK0000146719
花樣年控股	FTHDGR	B/B3/	7.875	2	5/27/2016	87.13	20.01	90.88	16.22	N	SGX-ST	HK0000150760
綠城中國	GRNCH	B+/B1/	5.625	2	5/13/2016	95.25	9.87	97.63	7.71	N	HONG KONG	XS0929019551
金輪天地控股	GWTH	B/B2/B	11.250	2	4/25/2016	96.25	14.85	99.38	11.81	N	HONG KONG	HK0000147428
麗豐控股	LAIFNG	B+/B1/BB-	6.875	2	4/25/2018	92.38	9.73	95.38	8.57	N	HONG KONG	XS0920162855
雷諾汽車	RENAUL	BB+/Ba1/BBB-	4.650	2	4/11/2016	98.50	6.04	101.00	3.73	N	EURONEXT-PARIS	FR0011459874
路勁基建	ROADKG	BB-/B1/	6.000	2	12/3/2016	93.25	10.26	96.13	8.39	N	HONG KONG	HK0000174448
離岸人民幣債券--無評等(僅供PI申請)												
UA金融(新鴻基子公司)	SUNHKC	//	6.900	2	5/2/2018	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	N	NOT LISTED	HK0000148368
國信證券子公司	GUOSEN	//	6.400	2	4/24/2017	99.13	6.84	101.50	5.65	N	HONG KONG	HK0000196698
紀互聯	VNET	//	6.875	2	6/26/2017	93.50	10.06	96.25	8.68	N	SGX-ST	HK0000204716
紀互聯	VNET	//	7.875	2	3/22/2016	97.08	10.83	100.08	7.78	N	SGX-ST	HK0000143658
豐德麗子公司	ESUNHO	//	8.375	2	6/24/2018	97.00	9.44	100.25	8.28	N	HONG KONG	XS1079725013
I.T LTD	IDOTHK	//	6.250	2	5/15/2018	89.11	10.30	92.94	8.81	N	HONG KONG	XS0929021375

人民幣離岸債券(CNH)參考報價表

2/23/2015

發行機構	Ticker	SP/Mdy's/ Fitch	票面 利率	付息 頻率	到期日	參考賣價 (%)	YTM_買價 (%)	參考買價 (%)	到期收益 (%)	次順位	掛牌交易所	ISIN Code / BB
遠東發展	FAEACO	//	5.875	2	3/4/2016	97.71	8.26	100.94	4.91	N	HONG KONG	HK0000141769
帝盛酒店集團	DORSET	//	6.000	2	4/3/2018	95.15	7.79	98.08	6.69	N	HONG KONG	HK0000145042
大唐集團	DATANG	//	4.500	2	6/15/2015	98.63	9.21	101.07	0.90	N	HONG KONG	HK0000115383
新世界中國	NEWWOR	//	8.500	2	4/11/2015	99.17	15.14	101.44	-2.78	N	HONG KONG	HK0000108776
新世界中國	NEWWOR	//	5.500	2	2/6/2018	98.48	6.07	101.11	5.09	N	HONG KONG	HK0000139235
中電國際	CHPOW	//	3.200	2	12/23/2015	97.31	6.62	99.87	3.36	N	NOT LISTED	HK0000073376
泛海集團	ASIAST	//	6.500	2	4/17/2018	95.50	8.15	98.50	7.04	N	HONG KONG	HK0000146537
海南航空(香港)	HAIAIR	//	6.250	2	5/22/2017	97.50	7.48	100.32	6.09	N	SGX-ST	SG6QD4000001
北控水務子公司	BJEHF	//	6.150	2	11/14/2022	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	N	NOT LISTED	HK0000171949
北控水務集團	BJEHF	//	5.000	2	6/30/2016	98.67	6.04	101.71	3.68	N	SGX-ST	HK0000083706
中租迪和	CHLEAS	//	5.000	2	4/5/2015	99.00	14.14	101.50	-7.95	N	SGX-ST	HK0000108412
中國智能交通系統(控制)有限公司	CHITS	//	10.000	2	11/8/2015	99.00	11.47	102.00	7.01	N	HONG KONG	XS0842212283
山東高速	SDEXPR	//	5.800	2	12/7/2015	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	#VALUE!	N	NOT LISTED	HK0000131752
麗新製衣	LAISUN	//	7.700	2	7/24/2018	96.30	8.98	99.35	7.92	N	HONG KONG	XS1088299745
齊魯國際	QLSECU	//	6.250	2	9/10/2017	96.58	7.76	99.28	6.56	N	HONG KONG	HK0000214392
361度國際	DEGREE	//	7.500	2	9/12/2017	90.87	11.75	94.04	10.22	N	HONG KONG	XS1106574129
香港航空公司	HONAIR	//	7.500	2	11/4/2016	99.71	7.68	102.89	5.68	N	HONG KONG	HK0000222064
海航集團	SANYPH	//	8.000	2	11/13/2017	94.52	10.35	97.71	8.96	N	SGX-ST	SG6UA9000004