



【2024-04-23】

今日 Fixing 定在 7.1059，较上一交易日上调了 16 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

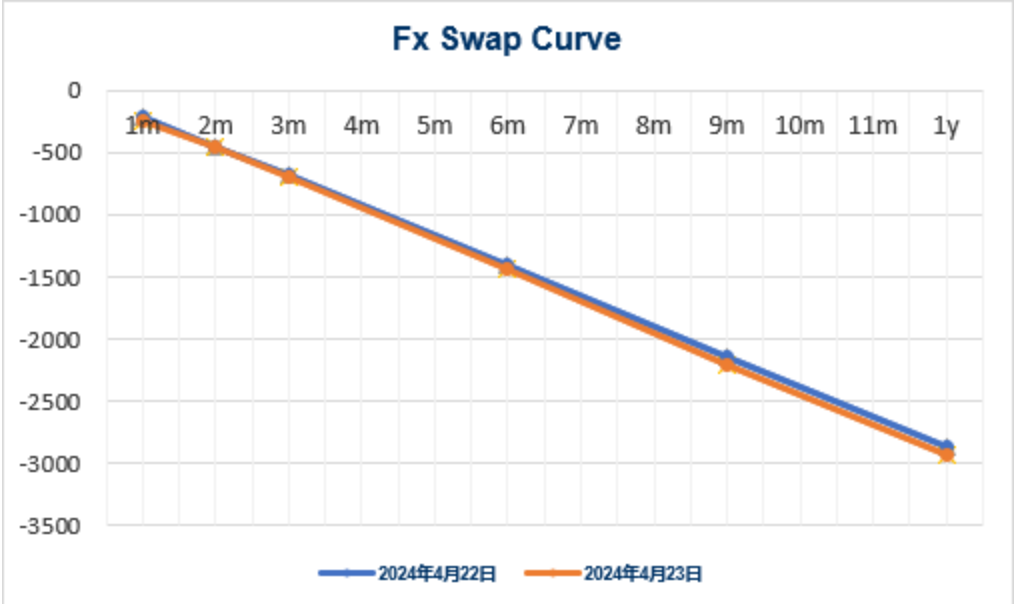
短端，O/N 成交在 -7.5~-7.25 的位置，T/N 成交在 -7.5~-7.25 的位置，S/N 成交在 -7.5~-7.35 的位置。1w 成交在 -82，-81.4 的位置；2w 成交在 -104.5，-104，-103.9 的位置；1s 成交在 -245.6，-245.3，-245 的位置；2s 成交在 -457 的位置；3s 成交在 -690，-685，-684 的位置；5s 成交在 -1176 的位置。

中长期，6s 成交在 -1445，-1440，-1439 的位置；9s 成交在 -2188 的位置；1y 反复成交在 -2923，-2900，-2895，-2886，-2885，-2884，-2880 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -23，-22.5 的位置；1y*2y 成交在 -2150 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	11	-83	7.2383	4.66
2W	14	-105	7.2361	-2
1M	33	-249	7.2218	-27.5
2M	61	-461	7.2005	-11
3M	91	-692	7.1774	-13
6M	183	-1442	7.1024	-41
9M	277	-2215	7.0251	-71
1Y	365	-2935	6.9531	-73
18M	550	-4140	6.8326	-80
2Y	732	-5080	6.7386	-130
3Y	1096	-6300	6.6166	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1059	
CLOSING SPOT RATE			7.2466	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-212.5	-443.5	-1193.5	-1966.5	-2686.5
2M		-231	-981	-1754	-2474
3M			-750	-1523	-2243
6M				-773	-1493
9M					-720



联系人：Rafael Wang
邮箱：rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明：

以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”） 仅用以提供信息，且为保密的和／或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN