



【2024-04-15】

今日 Fixing 定在 7.0979，较上一交易日下调了 12 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 -7.1~-6.9 的位置，T/N 成交在 -7.15~-7.08 的位置，S/N 成交在 -7.13~-7.08 的位置。1w 成交在 -49.9，-49.8，-49.7, 的位置；2w 成交在 -136.2，-136 的位置；1s 成交在 -217.4，-217.2，-217.1 的位置；2s 成交在 -442.5 的位置；3s 成交在 -668.5，-668 的位置；5s 成交在 -1160 的位置；4s 成交在 -918.5，-917 的位置；5s 成交在 -1148.5 的位置。

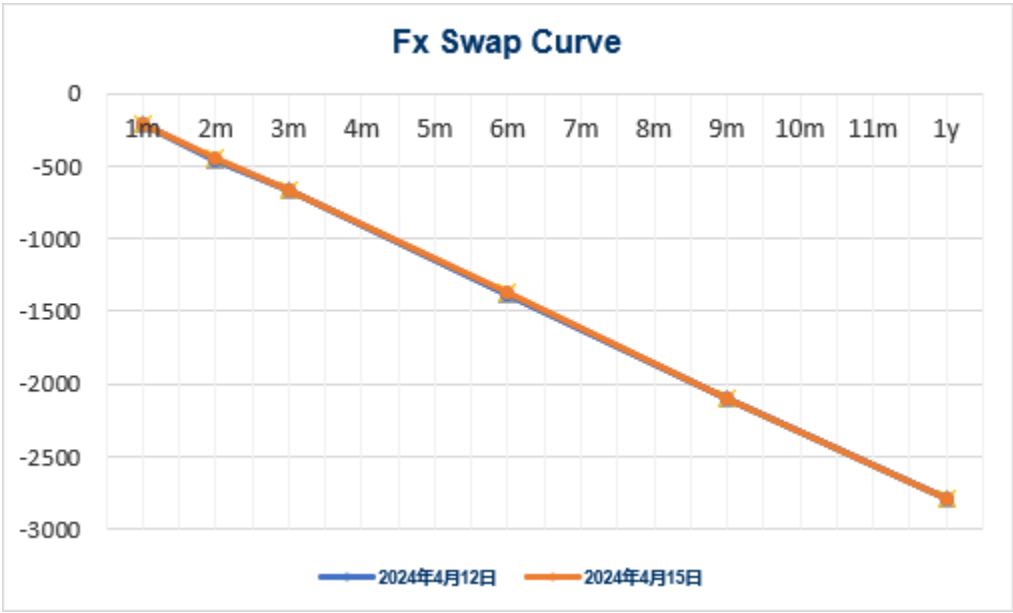
中长期限，6s 成交在 -1377，-1376.5，-1376 的位置；9s 成交在 -2098，-2097，-2096.5 的位置；1y 反复成交在 -2795，-2793，-2792，-2791，-2790，-2782 的位置。

超长期限，2y 成交在 -4750 的位置。

Spread 上，1w*1s 成交在 -167.5 的位置；3s*6s 成交在 -708 的位置；6s*9s 成交在 -721，-720 的位置；9s*1y 成交在 -698，-694 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2335	0
2W	19	-137	7.2248	-37
1M	30	-217	7.2168	-0.3
2M	61	-444	7.1941	9
3M	91	-668	7.1717	1.5
6M	183	-1376	7.1009	2
9M	275	-2098	7.0287	-3
1Y	365	-2796	6.9589	-3
18M	548	-3950	6.8435	-10
2Y	730	-4770	6.7615	-10
3Y	1097	-5945	6.6440	5
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0979	
CLOSING SPOT RATE			7.2385	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-226.5	-450.7	-1158.7	-1880.7	-2578.7
2M		-224.2	-932.2	-1654.2	-2352.2
3M			-708	-1430	-2128
6M				-722	-1420
9M					-698



文 / Edward Sun

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