



【2024-04-17】

今日 Fixing 定在 7.1025，较上一交易日上调了 3 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~-7.1 的位置，T/N 成交在 -7.35~-7.1 的位置，S/N 成交在 -22~-21.9 的位置。1w 成交在 -51.05， -51， -50.9 的位置；2w 成交在 -125 的位置；1s 成交在 -228， -227， -226 的位置；2s 成交在 -457， -456 的位置；3s 成交在 -676， -675， -673 的位置。

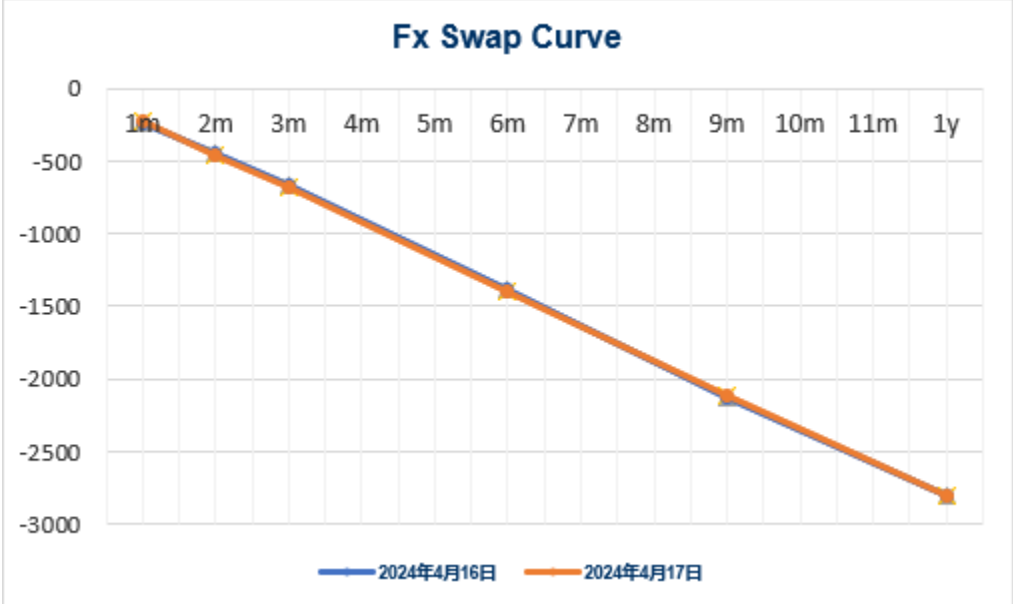
中长期，6s 成交在 -1405， -1403， -1400 的位置；9s 成交在 -2125， -2120， -2115 的位置；1y 反复成交在 -2828， -2827， -2826， -2825， -2820 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3970， -3960 的位置；2y 成交在 -4800 的位置。

Spread 上，1s*2s 成交在 -228 的位置；2s*3s 成交在 -219 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.2298	-0.65
2W	17	-125	7.2224	5
1M	31	-227	7.2122	6.5
2M	62	-454	7.1895	-8
3M	91	-673	7.1676	-1
6M	185	-1390	7.0959	-10
9M	277	-2111	7.0238	15
1Y	367	-2802	6.9547	4
18M	549	-3980	6.8369	-5
2Y	731	-4820	6.7529	0
3Y	1095	-6000	6.6349	55
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1025	
CLOSING SPOT RATE			7.2349	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-227	-446	-1163	-1884	-2575
2M		-219	-936	-1657	-2348
3M			-717	-1438	-2129
6M				-721	-1412
9M					-691



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