



【2023-07-24】

今日 Fixing 定在 7.1451，较上一交易日下调了 5 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端，O/N 成交在 -6.5~-5.5，T/N 成交在 -6.8~-6，S/N 成交在 -6.82~-6.28。1w 反复成交在 -48.5，-48.1，-48，-47.7，-47.6，-47.55，-47.4，-47 的位置；2w 成交在 -99，-98，-97.5 的位置；

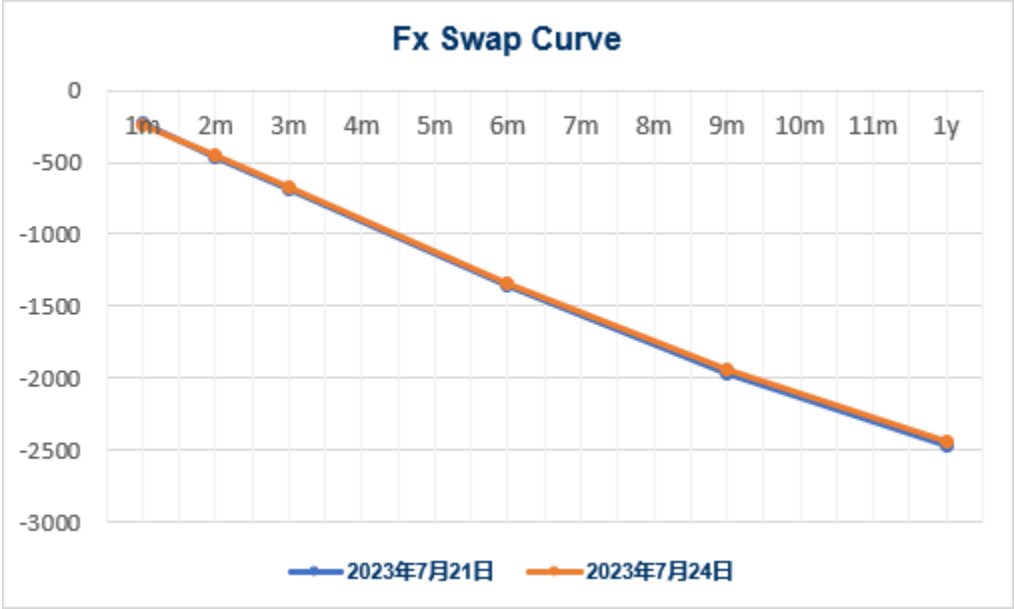
1s 成交在 -237，-235.5，-235，-234.5 的位置；2s 成交在 -454 的位置；3s 成交在-682，-681.5，-681，-679，-678，-677 的位置；

中长期，6s 成交在 -1352，-1350，-1348，-1347，-1346，-1345 的位置；9s 成交在 -1952，-1951，-1950，-1948，-1944.5，-1941.5 的位置；1y 反复成交在 -2456，-2454，-2453，-2450，-2449，-2448，-2447，-2445，-2443，-2442，-2441.5，-2440 的位置。

Spread 上，1s*3s 成交在-444 的位置；3s*6s 成交在-668 的位置，3s*9s 成交在-1270 的位置；6s*9s 成交在-602 的位置；9s*1y 成交在-493 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-47	7.1984	1.65
2W	14	-99	7.1933	2
1M	33	-235	7.1796	-10
2M	62	-456	7.1575	2
3M	92	-679	7.1352	6
6M	184	-1346	7.0685	15
9M	275	-1948	7.0083	18
1Y	366	-2449	6.9582	21
18M	551	-3250	6.8781	50
2Y	733	-3770	6.8261	5
3Y	1097	-4460	6.7571	90
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1451	
CLOSING SPOT RATE			7.2031	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-221	-444	-1111	-1713	-2214
2M		-223	-890	-1492	-1993
3M			-667	-1269	-1770
6M				-602	-1103
9M					-501



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