



【2023-07-20】

今日 Fixing 定在 7.1466，较上一交易日下降了 20 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端，O/N 主要成交在-6.8~-6.1。T/N 主要成交在-19.7~-18.8 的位置。S/N 主要成交在-6.8~-6.4 的位置。1w 成交在-46.8， -46.5， -47， -47.2， -47.5， 47.8， -48， -48.2， -48.4， -48.5 等位置。2w 成交在-98.3， -98.7， -99.3， -99.5， -100， -100.3， -100.5 的位置。1s 成交在-224.5， -225， -226， -225.5 的位置。2s 成交在-457， -460， -463， -464， -465， -467 等位置。3s 成交在-670， -675， -677， -680， -682， -683， -685 的位置。5s 成交在-1146， -1150 的位置。

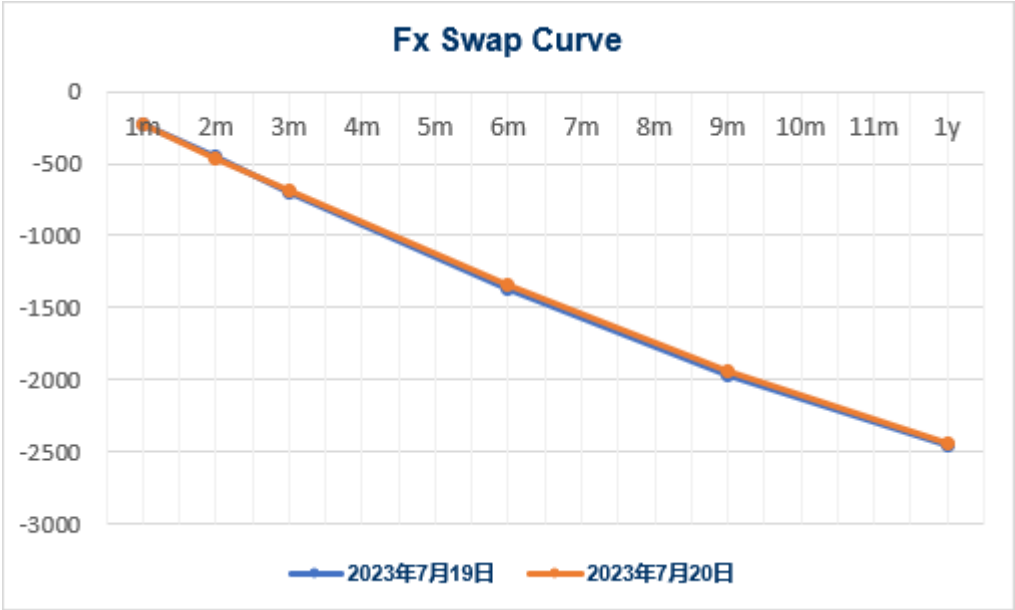
中长期，6s 成交在-1341， -1335， -1338， -1342， -1345， -1346， -1348， -1350 等位置。9s 成交在-1950， -1940， -1938， -1935， -1925， -1940， -1945 等位置。1y 成交在-2435， -2420， -2415， -2410， -2405， -2412， -2420， -2426， -2430， -2435， -2434 等位置。

超长方面，3y 成交在-4450 的位置。

Spread 方面，1*2w 成交在-51.4， -51.7， -52.1 的位置。6*9s 成交在-595 的位置。6*12s 成交在-1074， -1080， -1085 的位置。9*12s 成交在-495， -492 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1763	-1
2W	14	-100	7.1711	-3
1M	31	-226	7.1586	-0.3
2M	63	-467	7.1344	-10
3M	92	-686	7.1125	11
6M	184	-1346	7.0465	24
9M	275	-1947	6.9864	21
1Y	366	-2438	6.9373	23
18M	550	-3250	6.8561	-100
2Y	731	-3670	6.8141	30
3Y	1096	-4400	6.7411	-25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1466	
CLOSING SPOT RATE			7.1811	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-241.5	-460.5	-1120.5	-1721.5	-2212.5
2M		-219	-879	-1480	-1971
3M			-660	-1261	-1752
6M				-601	-1092
9M					-491



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