



【2023-07-17】

今日 Fixing 定在 7.1326 ，较上一交易日上调了 8 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下降。

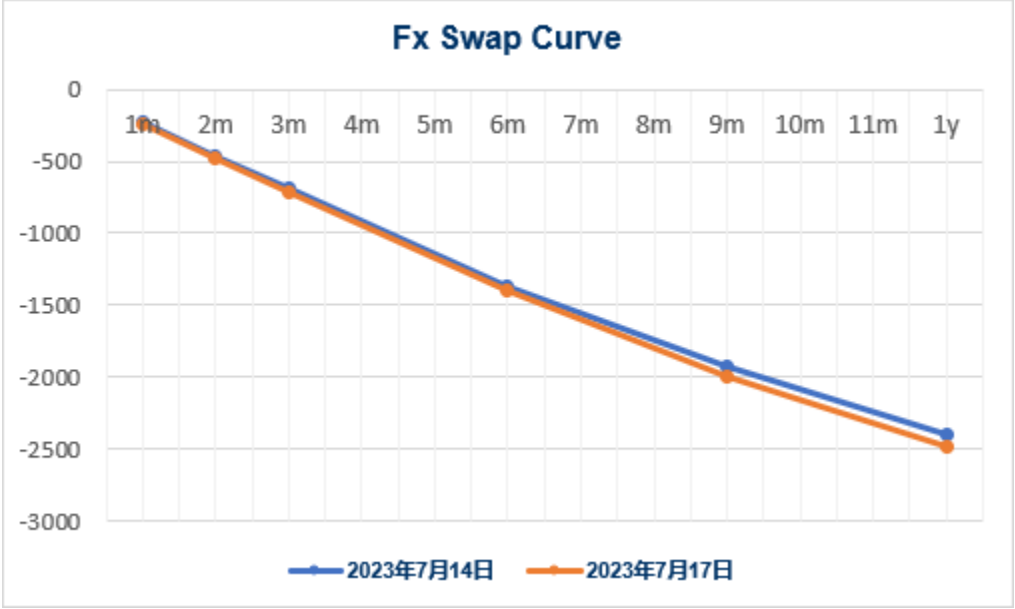
短端，O/N 成交在-7.2~-7.09 ， T/N 成交在 -7.23~-6.95 ， S/N 成交在 -7.3~-7.2。1w 反复成交在 -51.3, -51.25, -51.2, -51, -50.8, -50.5 的位置；2w 成交在 -103.5, -103, -102 的位置；1s 成交在 -247, -246, -245, -244 的位置；2s 成交在 -475, -474, -472, -471 的位置；3s 成交 -711, -710, -709, -708, -707, -705, -704, -703 的位置；

中长期限，6s 成交在 -1405, -1403, -1402, -1398, -1395 的位置；9s 成交在 -2000, -1999, -1998, -1997, -1995 的位置；1y 反复成交在 -2500, -2495, -2490, -2485, -2480 的位置；18s 成交在-3285, -3275 的位置。

Spread 上，2w*1s 成交在-144 的位置；1s*2s 成交在-226 的位置；3s*6s 成交在-695, -694 的位置； 6s*9s 成交在-595 的位置；6s*1y 成交在-1095 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.1651	-2.75
2W	14	-104	7.1598	-6
1M	33	-247	7.1455	-18.5
2M	62	-476	7.1226	-14
3M	92	-711	7.0991	-19
6M	184	-1405	7.0297	-40
9M	275	-1999	6.9703	-69
1Y	366	-2492	6.9210	-93
18M	552	-3250	6.8452	-50
2Y	733	-3810	6.7892	-160
3Y	1097	-4550	6.7152	-150
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1326	
CLOSING SPOT RATE			7.1702	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-229	-464	-1158	-1752	-2245
2M		-235	-929	-1523	-2016
3M			-694	-1288	-1781
6M				-594	-1087
9M					-493



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