



【2023-07-26】

今日 Fixing 定在 7.1295，较上一交易日下调了 111 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 -6.6~-5.9，T/N 成交在 -7.13~-6.4，S/N 成交在 -20.4~-19.4。1w 反复成交在 -49,-48.5,-48.4,-48.3,-48.2,-48 的位置；2w 成交在 -99.5,-99,-98.5 的位置；

1s 成交在 -230,-229,-228,-227.5,-227,-226.5,-226 的位置；2s 成交在 -458,-457,-456.5,-456,-455.5 的位置；3s 成交在 -693,-692,-691,-690,-689,-688,-687 的位置；

中长期，6s 成交在 -1350,-1348,-1346,-1345,-1344,-1343,-1342.5,-1341,-1338 的位置；9s 成交在 -1942,-1938,-1935,-1930.5 的位置；1y 反复成交在 -2435,-2431,-2430,-2429,-2428,-2427,-2425,-2424,-2423,-2422,-2420 的位置。

Spread 上，2w*1s 成交在 -128，-127.5，-127 的位置；6s*1y 成交在 -1082 的位置，9s*1y 成交在 -495 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1465	-2.5
2W	14	-100	7.1414	-5
1M	31	-228	7.1287	-1.5
2M	62	-458	7.1056	-10
3M	94	-689	7.0825	-24
6M	185	-1346	7.0168	-13
9M	276	-1936	6.9578	-16
1Y	367	-2435	6.9079	-30
18M	549	-3225	6.8289	-25
2Y	731	-3760	6.7754	-85
3Y	1096	-4450	6.7064	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1295	
CLOSING SPOT RATE			7.1514	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-230.5	-461.5	-1118.5	-1708.5	-2207.5
2M		-231	-888	-1478	-1977
3M			-657	-1247	-1746
6M				-590	-1089
9M					-499

文 / Ray Yan

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