



【2024-04-22】

今日 Fixing 定在 7.1043，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上行。

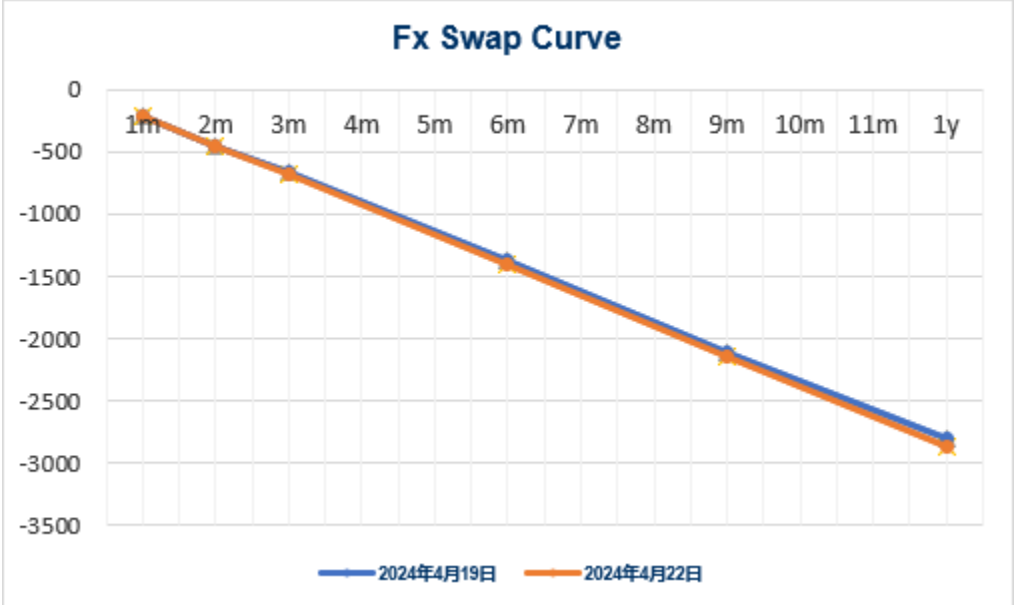
短端，O/N 成交在 -7.3~-7.15 的位置，T/N 成交在 -7.35~-7.1 的位置，S/N 成交在 -7.3~-7.2 的位置。1w 成交在 -87.5，-87 的位置；2w 成交在 -102 的位置；1s 成交在 -220，-219，-218 的位置；2s 成交在 -450，-449 的位置；4s 成交在 -930 的位置；5s 成交在 -1154，-1153 的位置。

中长期，6s 成交在 -1394，-1393 的位置；9s 成交在 -2138，-2133，-2132 的位置；1y 反复成交在 -2850，-2845，-2840，-2839，-2838，-2833 的位置。

Spread 上，5s*6s 成交在 -240 的位置；6s*9s 成交在 -743，-740 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	12	-88	7.2348	-37.89
2W	14	-103	7.2333	-3
1M	30	-221	7.2215	-3.4
2M	61	-451	7.1986	4
3M	91	-679	7.1757	-9.5
6M	183	-1401	7.1035	-21
9M	275	-2144	7.0292	-38
1Y	365	-2862	6.9574	-52
18M	548	-4060	6.8376	-110
2Y	730	-4950	6.7486	-150
3Y	1097	-6250	6.6186	-250
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1043	
CLOSING SPOT RATE			7.2436	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-229.5	-458	-1180	-1923	-2641
2M		-228.5	-950.5	-1693.5	-2411.5
3M			-722	-1465	-2183
6M				-743	-1461
9M					-718



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