



【2024-04-25】

今日 Fixing 定在 7.1058，较上一交易日上调了 10 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

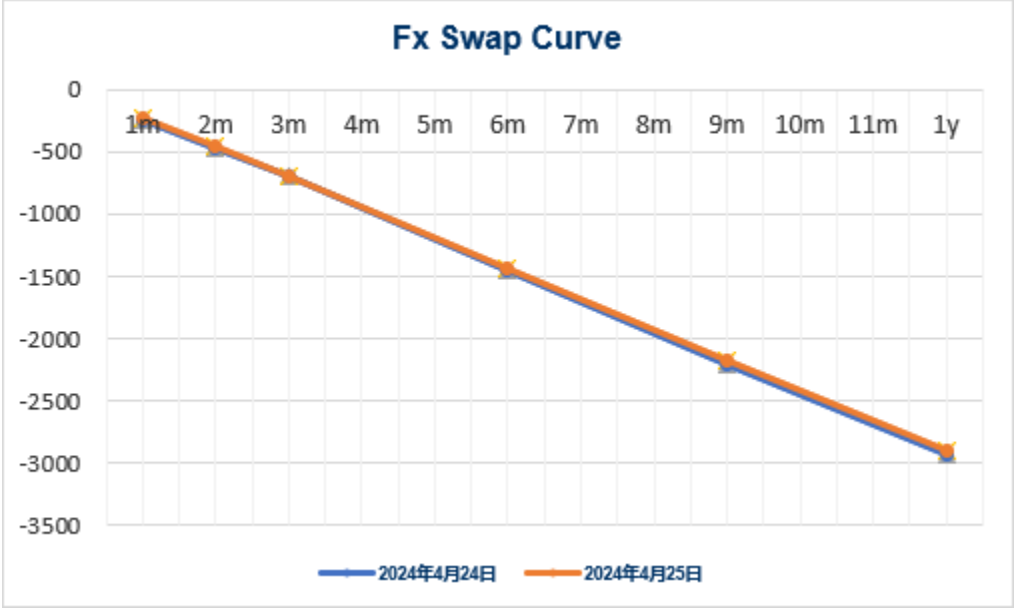
短端，O/N 成交在 -7.6~-6.8 的位置，T/N 成交在 -8~-7.3 的位置，S/N 成交在 -7.6~-7.28 的位置。1w 成交在 -54.7，-53.51，-53.5 的位置；2w 成交在 -110，-109.2 的位置；1s 成交在 -231，-228 的位置；2s 成交在 -462 的位置；3s 成交在 -703，-702 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1440，-1430 的位置；9s 成交在 -2190，-2180，-2158 的位置；1y 反复成交在 -2940，-2939，-2930，-2925，-2918，-2915，-2910，-2895，-2885 的位置。

Spread 上，1s*2s 成交在 -231 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2418	26.6
2W	14	-107	7.2364	4
1M	30	-228	7.2243	21.7
2M	60	-458	7.2013	16
3M	91	-698	7.1773	6
6M	183	-1433	7.1038	26
9M	273	-2170	7.0301	40
1Y	365	-2895	6.9576	43
18M	548	-4080	6.8391	70
2Y	730	-5000	6.7471	10
3Y	1095	-6250	6.6221	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1058	
CLOSING SPOT RATE			7.2471	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-230	-470	-1205	-1942	-2667
2M		-240	-975	-1712	-2437
3M			-735	-1472	-2197
6M				-737	-1462
9M					-725



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