



【2023-07-28】

今日 Fixing 定在 7.1338，较上一交易日上调了 73 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅下跌。

短端，O/N 成交在-21.5~-20.5。T/N 成交-7.5~-7.35。S/N 成交在-7.48~-7.35。1w 成交在-52~-51.7。3w 成交在-155.5，-155。1s 成交在-232~-227。2s 成交在-523~-521。3s 成交在-690~-687，尾盘收在-687。

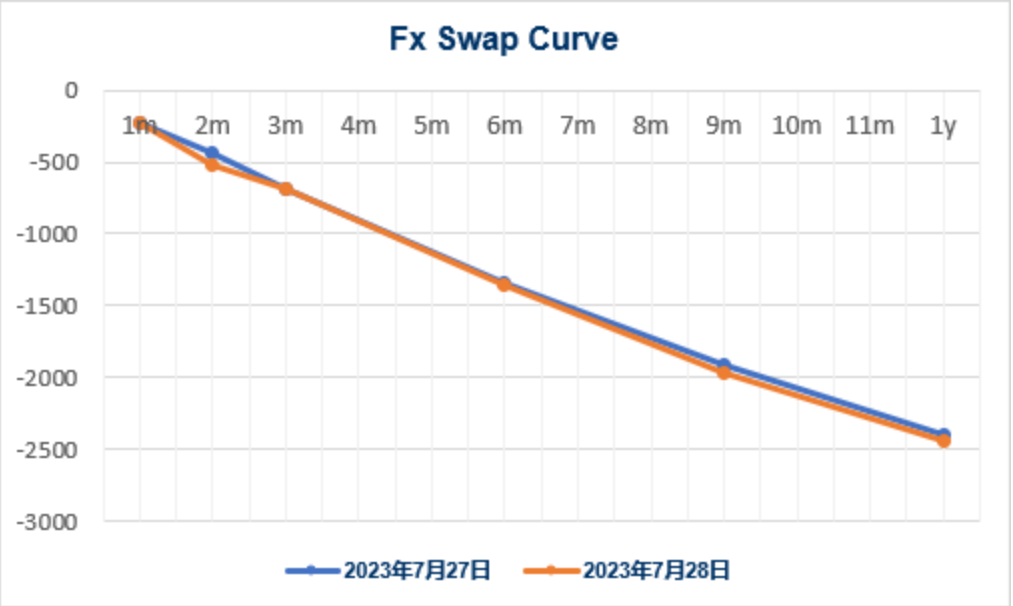
中长期限，6s 成交在-1358~-1350，尾盘收在-1350。9s 成交在-1968。1y 成交在-2450~-2438，尾盘收在-2438。

长期限上，18s 成交在-3230。

Spread 上，3w*1s 成交在-75，-74.5。3*6s 成交在-665~-663。9*12s 成交在-474。1*2y 成交在-1310。12*18s 成交在-790。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.1593	-0.75
2W	14	-108	7.1537	-6
1M	31	-229	7.1416	-1
2M	70	-521	7.1125	-83
3M	92	-688	7.0958	-6.5
6M	184	-1351	7.0294	-15
9M	274	-1968	6.9677	-55
1Y	366	-2438	6.9207	-33
18M	553	-3240	6.8405	60
2Y	731	-3756	6.7889	-76
3Y	1098	-4465	6.7180	-115
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1338	
CLOSING SPOT RATE			7.1645	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-291.5	-458.5	-1122	-1739	-2209
2M		-167	-830.5	-1447.5	-1917.5
3M			-663.5	-1280.5	-1750.5
6M				-617	-1087
9M					-470



文 / Jason Ge

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