



【2024-04-19】

今日 Fixing 定在 7.1046，较上一交易日下调了 26 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

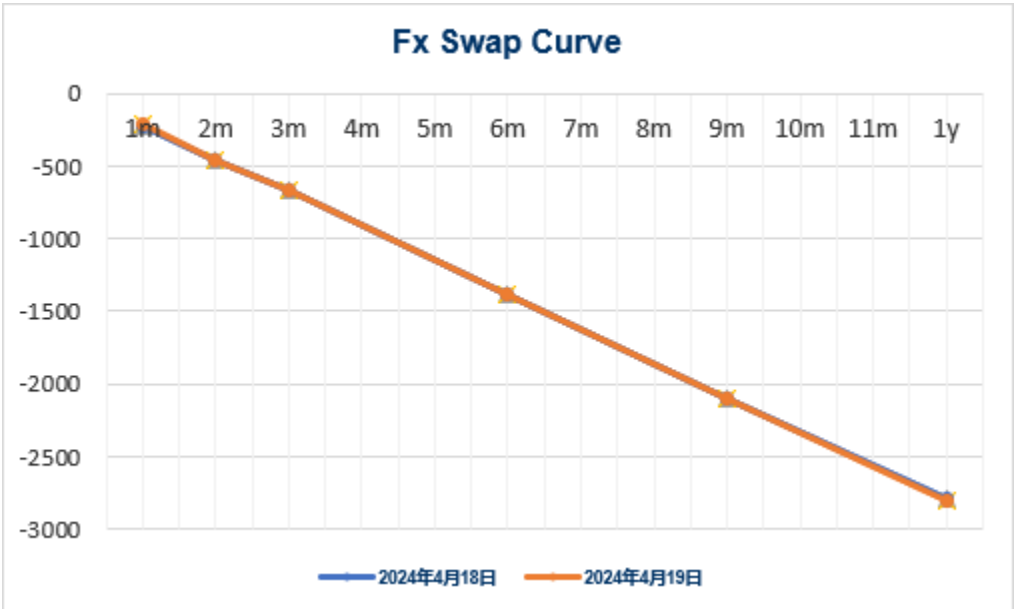
短端，O/N 成交在 -20.6~-20.25 的位置，T/N 成交在 -7.1~-7.05 的位置，S/N 成交在 -7.09~-7.07 的位置。1w 成交在 -49.8， -49.75 的位置；2w 成交在 -100.5， -100 的位置；1s 成交在 -218， -217.8 的位置；2s 成交在 -455， -454 的位置；3s 成交在 -672， -671， -670 的位置。

中长期，6s 成交在 -1380， -1378， -1376 的位置；9s 成交在 -2100， -2099， -2098， -2088 的位置；1y 反复成交在 -2805， -2785， -2780 的位置。

超长期限，2y 成交在 -4780， -4745 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2351	0.02
2W	14	-100	7.2301	1
1M	30	-218	7.2183	0.6
2M	62	-454	7.1947	8
3M	91	-670	7.1732	2.5
6M	183	-1380	7.1021	-3
9M	275	-2106	7.0295	-10
1Y	365	-2810	6.9591	-15
18M	548	-3950	6.8451	-5
2Y	730	-4800	6.7601	13
3Y	1095	-6000	6.6401	-75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1046	
CLOSING SPOT RATE			7.2401	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-236.4	-451.9	-1162.4	-1888.4	-2592.4
2M		-215.5	-926	-1652	-2356
3M			-710.5	-1436.5	-2140.5
6M				-726	-1430
9M					-704



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