



【2023-07-21】

今日 Fixing 定在 7.1456，较上一交易日下调了 10 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅下跌。

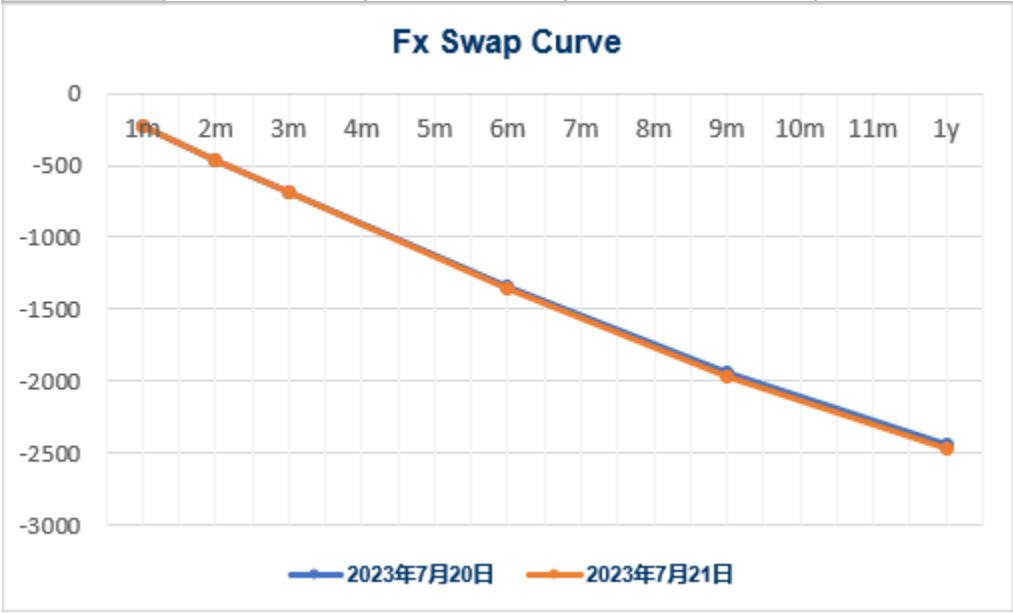
短端，O/N 成交在-20~-17.5。T/N 成交-6.95~-6.1。S/N 成交在-6.95~-6.71。1w 成交在-50~-48.5。2w 成交在-102。1s 成交在-227~-225.5。2s 成交在-460。3s 成交在-688~-685，尾盘收在-685。

中长期，6s 成交在-1360~-1357，尾盘收在-1360。9s 成交在-1960。1y 成交在-2475~-2455，尾盘收在-2462。

Spread 上，1*2s 成交在-234.5。9*12s 成交在-500。6*12s 成交在-1100。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1741	-0.15
2W	14	-101	7.1690	-1
1M	31	-225	7.1565	0.5
2M	62	-458	7.1332	9
3M	92	-685	7.1105	1
6M	184	-1361	7.0429	-15
9M	275	-1966	6.9824	-19
1Y	366	-2470	6.9320	-32
18M	552	-3300	6.8490	-50
2Y	731	-3775	6.8015	-105
3Y	1098	-4550	6.7240	-150
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1456	
CLOSING SPOT RATE			7.1790	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-233	-460	-1136	-1741	-2245
2M		-227	-903	-1508	-2012
3M			-676	-1281	-1785
6M				-605	-1109
9M					-504



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：
以上所含及增加的所有信息（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。