



【2023-04-14】

今日 Fixing 定在 6.8606，较上一交易日下调了 52 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上涨。

短端，O/N 成交在-19~-18。T/N 成交在-6.45~-6.2。S/N 成交在-6.35~-6.07。1w 成交在-43.3~-42.8。3w 成交在-127。1s 成交在-181~-180。2s 成交在-377~-376。3s 成交在-542~-540，尾盘收在-542。

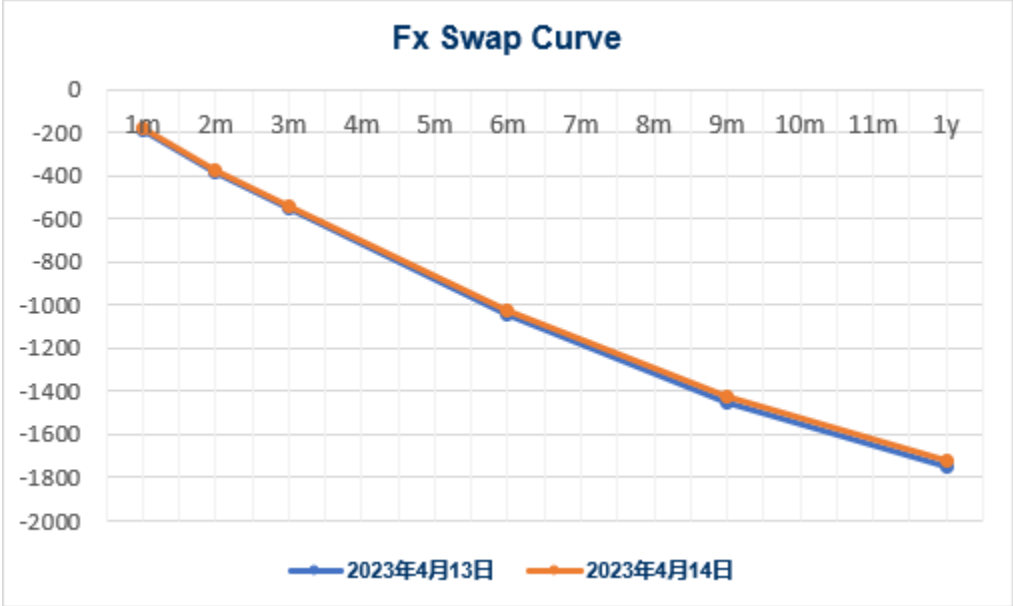
中长期限，6s 成交在-1028~-1020，尾盘收在-1026。9s 成交在-1425。1y 成交在-1730~-1718，尾盘收在-1725。

长期限上，3y 成交-2200。

Spread 上，2*3s 成交在-165。3*6s 成交在-482。9*12s 成交在-298。12*18s 成交在-300。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	6.8452	1.28
2W	16	-96	6.8399	9
1M	30	-180	6.8315	4.3
2M	63	-378	6.8118	10
3M	91	-542	6.7953	8
6M	183	-1028	6.7467	17
9M	275	-1425	6.7070	26
1Y	366	-1725	6.6770	29
18M	549	-2040	6.6455	50
2Y	731	-2120	6.6375	5
3Y	1098	-2170	6.6325	5
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8606	
CLOSING SPOT RATE			6.8495	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-197.2	-361.7	-847.7	-1244.7	-1544.7
2M		-164.5	-650.5	-1047.5	-1347.5
3M			-486	-883	-1183
6M				-397	-697
9M					-300



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推介、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。