



【2023-04-13】

今日 Fixing 定在 6.8658，较上一交易日下降了 196 个 bp。各期限收盘价较上一交易日略微有所上升。

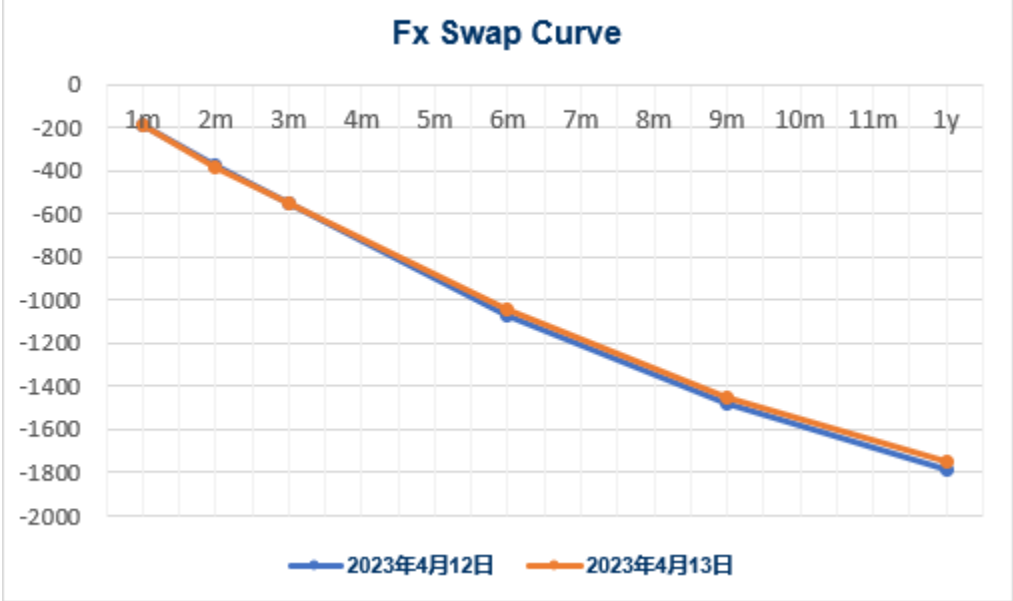
短端，O/N 主要成交在-7~-6.45。T/N 主要成交在-19.5~-19.1 的位置。S/N 主要成交在-6.55~-6.4 的位置。1w 成交在-44.1， -44.15， -44.2， -44.25， -44.22， -44.2 等位置。2w 成交在-104， -104.3， -104.5， 等位置。3w 成交在-128.8 的位置。1s 成交在-183.5， -184， -184.3， -184.5 的位置。2s 成交在-385， -387， -388.5， -387.5 等位置。3s 成交在-550， -552， -551， 551.5， -550.5 等位置。

中长期，6s 成交在-1055， -1056， -1052， -1050， -1045 等位置。9s 成交在-1465， -1462， -1460， -1455 等位置。1y 成交在-1770， -1768， -1762， -1760， -1756， -1750 等位置。

Spread 方面，2w*3w 成交在-24.5 的位置。1s*2s 成交在-203.5， 203 的位置。2s*3s 成交在-165 的位置。9s*12s 成交在-300 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	6.8677	-0.18
2W	17	-105	6.8616	-17
1M	30	-185	6.8536	5.4
2M	64	-387	6.8334	-14
3M	91	-550	6.8171	5
6M	183	-1045	6.7676	25
9M	275	-1451	6.7270	33
1Y	366	-1754	6.6968	38
18M	549	-2090	6.6631	60
2Y	731	-2125	6.6596	125
3Y	1096	-2175	6.6546	125
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8658	
CLOSING SPOT RATE			6.8721	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-202.4	-365.4	-860.4	-1266.4	-1568.9
2M		-163	-658	-1064	-1366.5
3M			-495	-901	-1203.5
6M				-406	-708.5
9M					-302.5



文 /Yiff Wang

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：
以上所登及附加的所有信息（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，所有前述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN