【2024-04-09】

今日 Fixing 定在 7.0956，较上一交易日上调了 9 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

短端，O/N 成交在 -7.1~-6.8 的位置，T/N 成交在 -7.2~-7.14 的位置，S/N 成交在 -7.19~-7.15 的位置。1w 成交在 -50.3，-50 的位置；2w 成交在 -99.95 的位置；1s 成交在 -230.5，-230 的位置；3s 成交在 -662，-661，-660.5，-660 的位置；4s 成交在 -900，-899 的位置；5s 成交在 -1130，-1128 的位置。

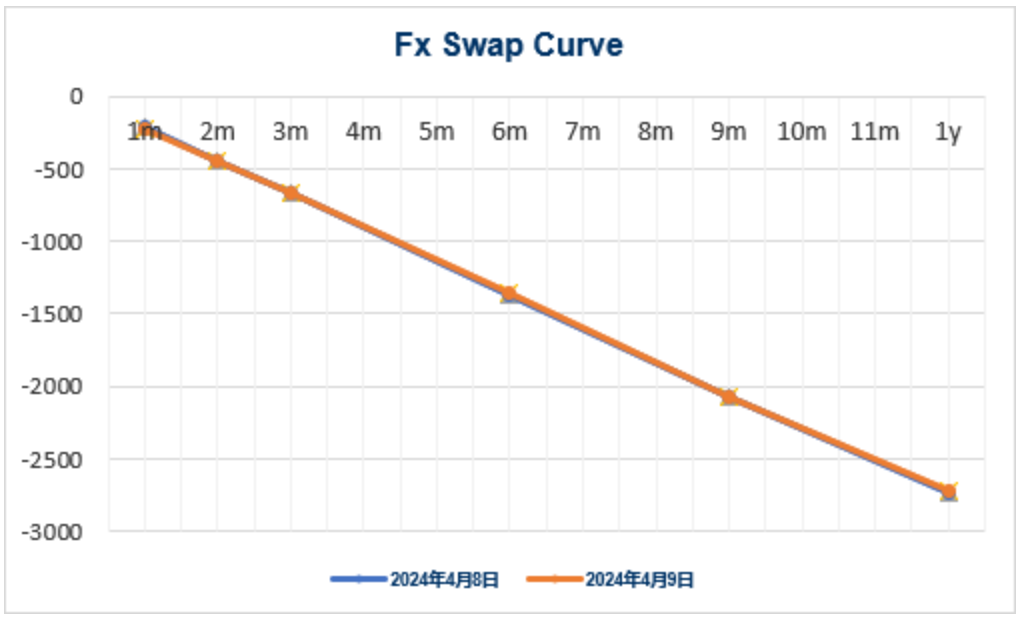
中长期限，6s 成交在 -1362，-1354 的位置；9s 成交在 -2069，-2066 的位置；1y 反复成交在 -2741，-2740，-2739，-2735，-2730 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3820，-3810，-3800 的位置。

Spread 上，3s*4s 成交在 -240 的位置；3s*6s 成交在 -694 的位置；4s*5s 成交在 -229，-228 的位置；6s*9s 成交在 -715 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2288	0.19
2W	14	-100	7.2238	1
1M	25	-231	7.2108	-14.5
2M	61	-442	7.1897	8
3M	91	-661	7.1677	2.2
6M	183	-1355	7.0983	9
9M	277	-2069	7.0269	-1
1Y	365	-2717	6.9621	17
18M	551	-3811	6.8527	-1
2Y	732	-4550	6.7788	20
3Y	1096	-5750	6.6588	30
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0956	
CLOSING SPOT RATE			7.2338	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-211	-430.3	-1124.5	-1838.5	-2486.5
2M		-219.3	-913.5	-1627.5	-2275.5
3M			-694.2	-1408.2	-2056.2
6M				-714	-1362
9M					-648



文 / Edward Sun

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。