

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列

**NEX** 上海国际货币经纪  
Shanghai CFETS-NIX International Money Broking

**【2023-04-06】**

今日 Fixing 定在 6.8747，较上一交易日上升了 48 个 bp。各期限收盘价较上一交易日略微有所上升，今日交投较活跃。

短端，O/N 主要成交在-6.8~-6.3。T/N 主要成交在-18.85~-18.3 的位置。S/N 主要成交在-6.35~-6.05 的位置。1w 成交在-43.5, -43, -42.8, -42.7, -42.6, -42.65, -42.55 等位置。2w 成交在-83, -82.8 等位置。3w 成交在-141, -140 的位置。1s 成交在-175, -176, -176.5 的位置。2s 成交在-369, -369.5 等位置。3s 成交在-528, -530, -532, -533, -534.5, -534 等位置。

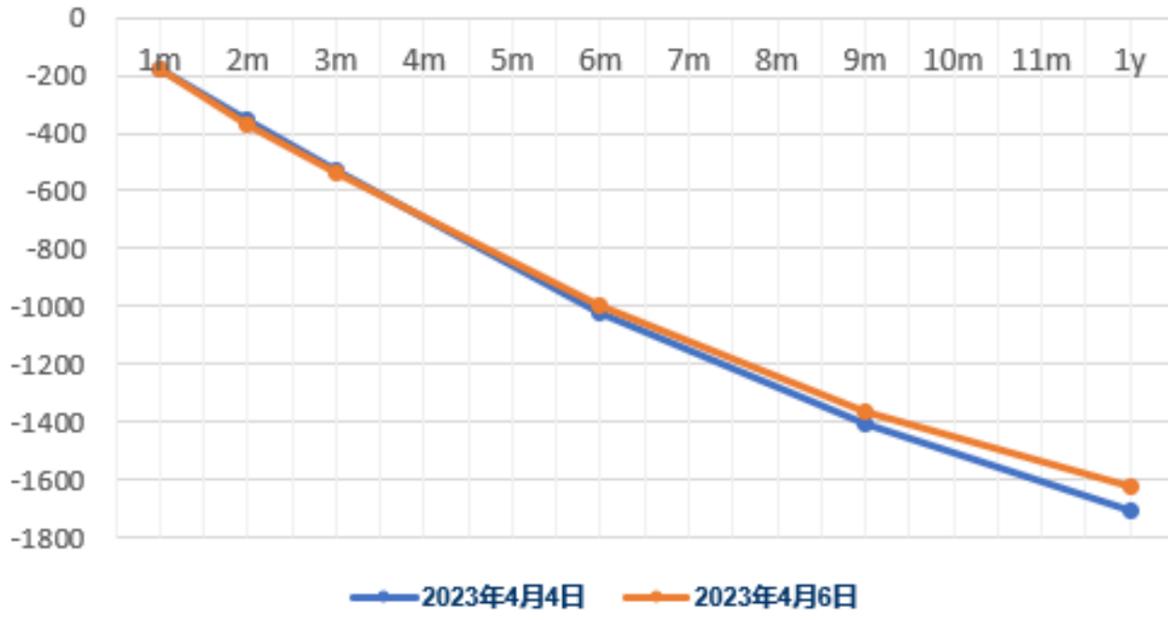
中长期，6s 成交在-985, -990, -995, -998, -997, -1000, -1003, -1001, -997 等位置。9s 成交在-1355, -1360, -1365, -1370, -1368, -1365 等位置。1y 成交在-1610, -1620, -1633, -1640, -1635, -1632, -1630, -1625 等位置。

Spread 方面，1w\*2w 成交在-40.4 的位置。1s\*2s 成交在-192.5 的位置。2s\*3s 成交在-165 的位置。9s\*12s 成交在-273 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	6.8764	0.85
2W	14	-83	6.8724	2
1M	30	-178	6.8629	3.4
2M	63	-370	6.8438	-13
3M	91	-534	6.8273	-4
6M	183	-998	6.7809	25
9M	275	-1363	6.7444	47
1Y	366	-1625	6.7182	82
18M	549	-1925	6.6882	140
2Y	731	-1890	6.6917	210
3Y	1096	-1950	6.6857	275
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8747	
CLOSING SPOT RATE			6.8807	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-191.9	-356.4	-820.4	-1185.4	-1447.4
2M		-164.5	-628.5	-993.5	-1255.5
3M			-464	-829	-1091
6M				-365	-627
9M					-262

## Fx Swap Curve



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:

以上所提及的所有信息（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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)