



【2023-04-21】

今日 Fixing 定在 6.8752，较上一交易日下调了 235 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅上涨。

短端，O/N 成交在-14.2~-13.5。T/N 成交在-5.25~-5.05。S/N 成交在-5.16~-5.08。1w 成交在-49.4~-48。2w 成交在-80.5， -80， -79.5。1s 成交在-176~-173。2s 成交在-370~-366。3s 成交在-543~-535，尾盘收在-543。5s 成交在-890。

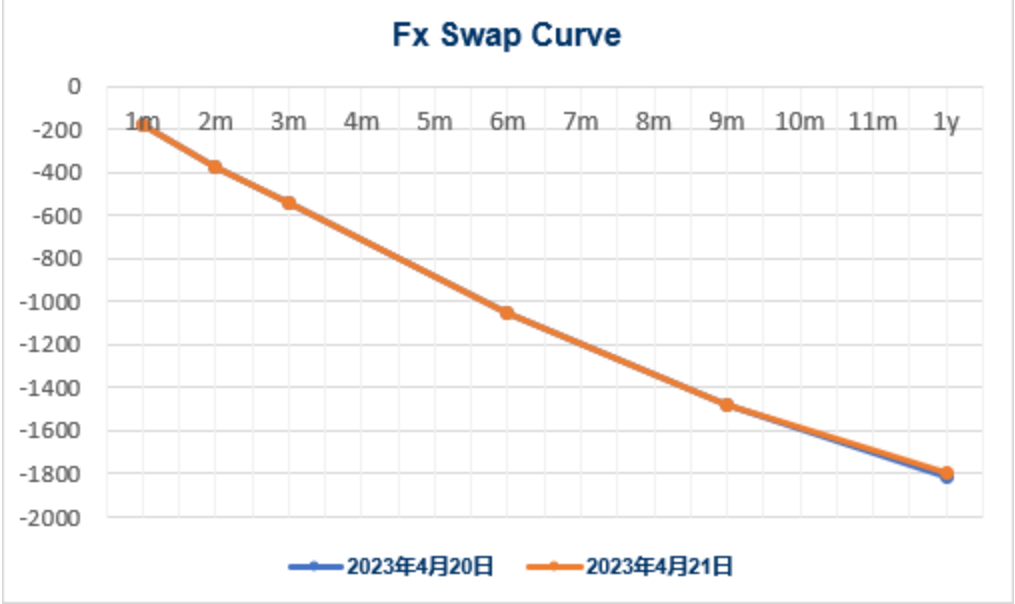
中长期限，6s 成交在-1050~-1030，尾盘收在-1048。9s 成交在-1470。1y 成交在-1795~-1765，尾盘收在-1795。

长期限上，2y 成交-2320。3y 成交在-2350。

Spread 上，3*6s 成交在-497。12*18s 成交在-410。1*2y 成交在-520。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	9	-48	6.8850	7.65
2W	14	-80	6.8818	1
1M	30	-176	6.8723	0
2M	62	-372	6.8526	6
3M	91	-544	6.8354	0.5
6M	183	-1055	6.7843	-6
9M	275	-1485	6.7413	0
1Y	366	-1800	6.7098	13
18M	549	-2170	6.6728	80
2Y	731	-2300	6.6598	150
3Y	1098	-2350	6.6548	250
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8752	
CLOSING SPOT RATE			6.8898	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-196.5	-368.5	-879.5	-1309.5	-1624.5
2M		-172	-683	-1113	-1428
3M			-511	-941	-1256
6M				-430	-745
9M					-315



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。