【2023-04-24】

今日 Fixing 定在 6.8835，较上一交易日上调了 83 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 成交在-6.15~-5.95， T/N 成交在-6.28~-5.88，S/N 成交在-6.25~-5.95。1w 反复成交在-49，-48，-47.8，-47.6，-47.5，-47.2，-47，-46 的位置； 2w 成交在-84.5 的位置；3w 成交在-130 的位置；

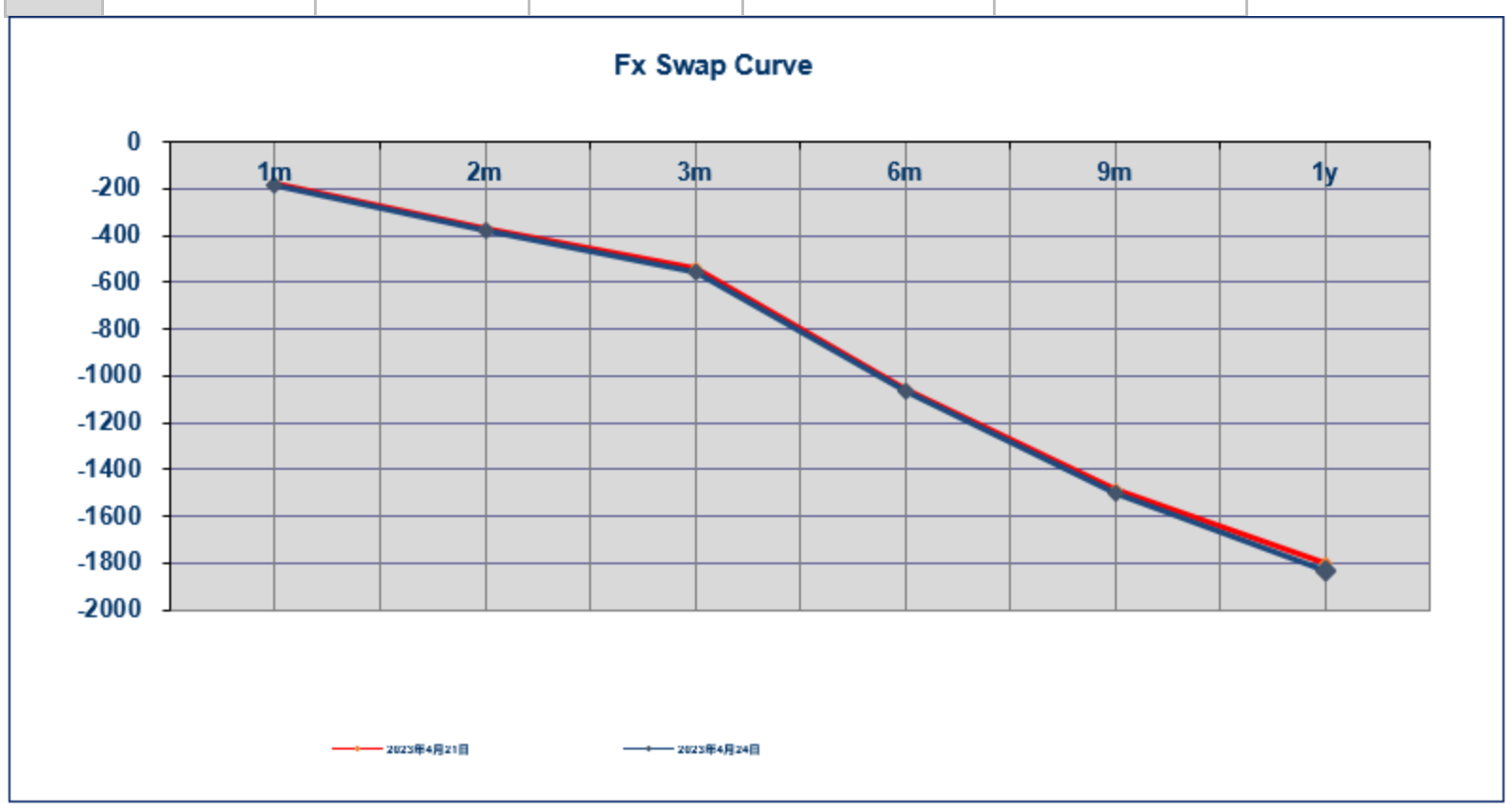
1s 成交在-185，-184.5，-184，-183.5 的位置；2s 成交在-376.5 的位置；3s 成交在-555，-554，-553 的位置；5s 成交在-904 的位置；

中长期限，6s 成交在-1068，-1066，-1064，1062 的位置；9s 成交在-1505，-1504，-1503 的位置；1y 反复成交在-1835，-1830，-1829 的位置；3y 成交在-2590，-2550 的位置；

Spread 上，3w*1s 成交在-55 的位置；3s*6s 反复成交在-515 的位置；5s*6s 成交在-158 的位置；1y*2y 成交在-565 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-45	6.8940	2.75
2W	14	-85	6.8901	-5
1M	34	-183	6.8802	-7.2
2M	62	-377	6.8609	-5
3M	90	-554	6.8431	-10
6M	182	-1065	6.7920	-10
9M	274	-1502	6.7483	-17
1Y	365	-1835	6.7150	-35
18M	548	-2170	6.6815	0
2Y	731	-2300	6.6685	0
3Y	1098	-2350	6.6635	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8835	
CLOSING SPOT RATE			6.8985	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-193.3	-370.8	-881.8	-1318.8	-1651.8
2M		-177.5	-688.5	-1125.5	-1458.5
3M			-511	-948	-1281
6M				-437	-770
9M					-333



文 / Ray Yan

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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN