



【2024-04-08】

今日 Fixing 定在 7.0947，较上一交易日上调了 2 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 -7.3~-7.05 的位置，T/N 成交在 -7.25~-7.05 的位置，S/N 成交在 -7.23~-7.15 的位置。1w 成交在 -50.4，-50.1 的位置；2w 成交在 -102，-101 的位置；1s 成交在 -217.5，-216.5 的位置；3s 成交在 -664，-663 的位置；5s 成交在 -1136 的位置。

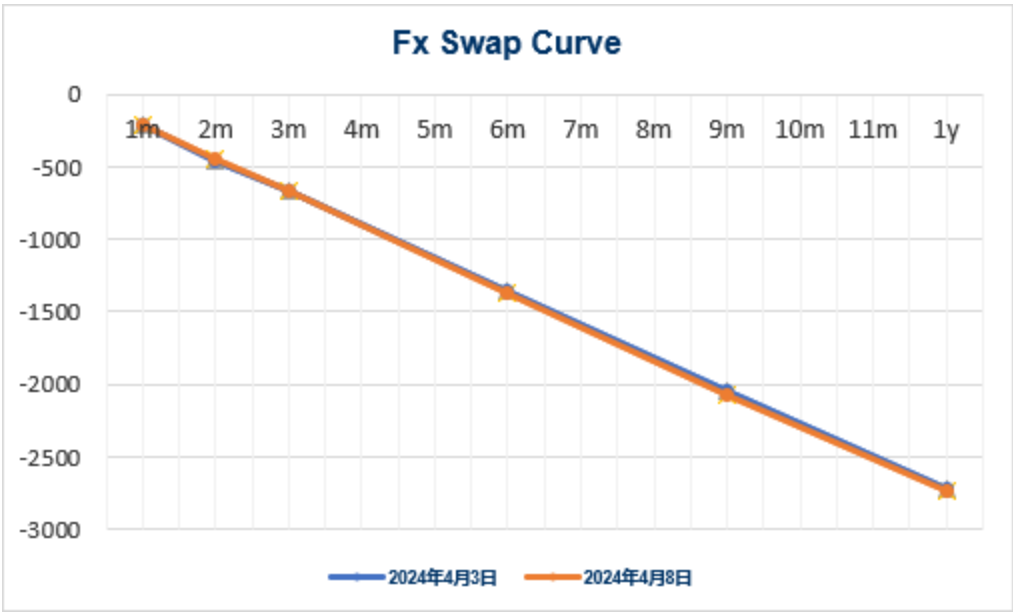
中长期限，6s 成交在 -1369，-1367 的位置；9s 成交在 -2075，-2074，-2073 的位置；1y 反复成交在 -2750，-2746，-2742，-2740，-2735 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3830 的位置；2y 成交在 -4550，-4544 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -50.7 的位置；5s*6s 成交在 -233 的位置；6s*9s 成交在 -706，-705 的位置；3s*6s 成交在 -705 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2287	1.1
2W	14	-101	7.2236	1
1M	26	-216	7.2121	-1
2M	62	-449	7.1888	7
3M	91	-663	7.1674	-1
6M	183	-1364	7.0973	-7
9M	275	-2068	7.0269	-17
1Y	365	-2734	6.9603	-14
18M	548	-3810	6.8527	-25
2Y	730	-4570	6.7767	-55
3Y	1097	-5780	6.6557	-80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0947	
CLOSING SPOT RATE			7.2337	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-233	-447	-1148	-1852	-2518
2M		-214	-915	-1619	-2285
3M			-701	-1405	-2071
6M				-704	-1370
9M					-666



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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN