



【2023-04-10】

今日 Fixing 定在 6.8764，较上一交易日下调了 74 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-6.6~-6.2， T/N 成交在-6.74~-6.67， S/N 成交在-6.63~-6.59。1w 反复成交在-44， -43.9， -43.8 的位置； 2w 成交在-85.5 的位

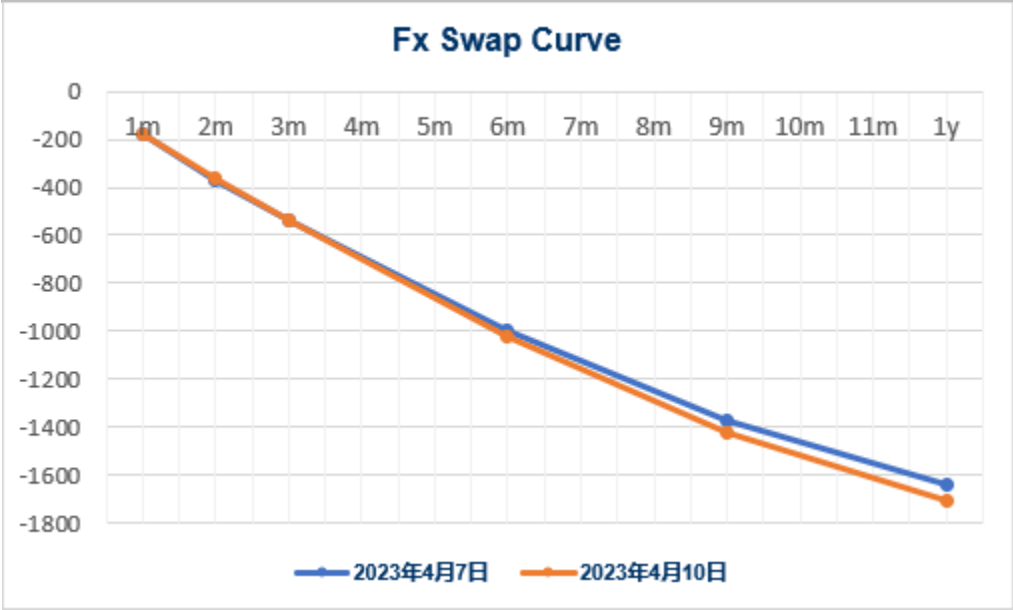
置； 1s 成交在-178 的位置； 2s 成交在-366， -363 的位置； 3s 成交在-540， -539， -538 的位置； 4s 成交在-718 的位置；

中长期限， 6s 成交在-1030， -1027， -1026， -1025 的位置； 9s 成交在-1427， -1425， -1418， -1410， -1407 的位置； 1y 反复成交在-1715， -1713， -1710， -1708， -1705， -1700 的位置；

Spread 上， 3s*6s 成交在-487 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	6.8696	-0.35
2W	14	-86	6.8654	-1
1M	30	-181	6.8559	-1.4
2M	61	-366	6.8374	3
3M	91	-540	6.8200	-5.5
6M	183	-1026	6.7714	-27
9M	275	-1425	6.7315	-47
1Y	366	-1706	6.7034	-67
18M	549	-2055	6.6685	-130
2Y	733	-2100	6.6640	-200
3Y	1097	-2150	6.6590	-200
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8764	
CLOSING SPOT RATE			6.8740	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-185	-359	-845	-1244	-1525
2M		-174	-660	-1059	-1340
3M			-486	-885	-1166
6M				-399	-680
9M					-281



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