



【2023-04-17】

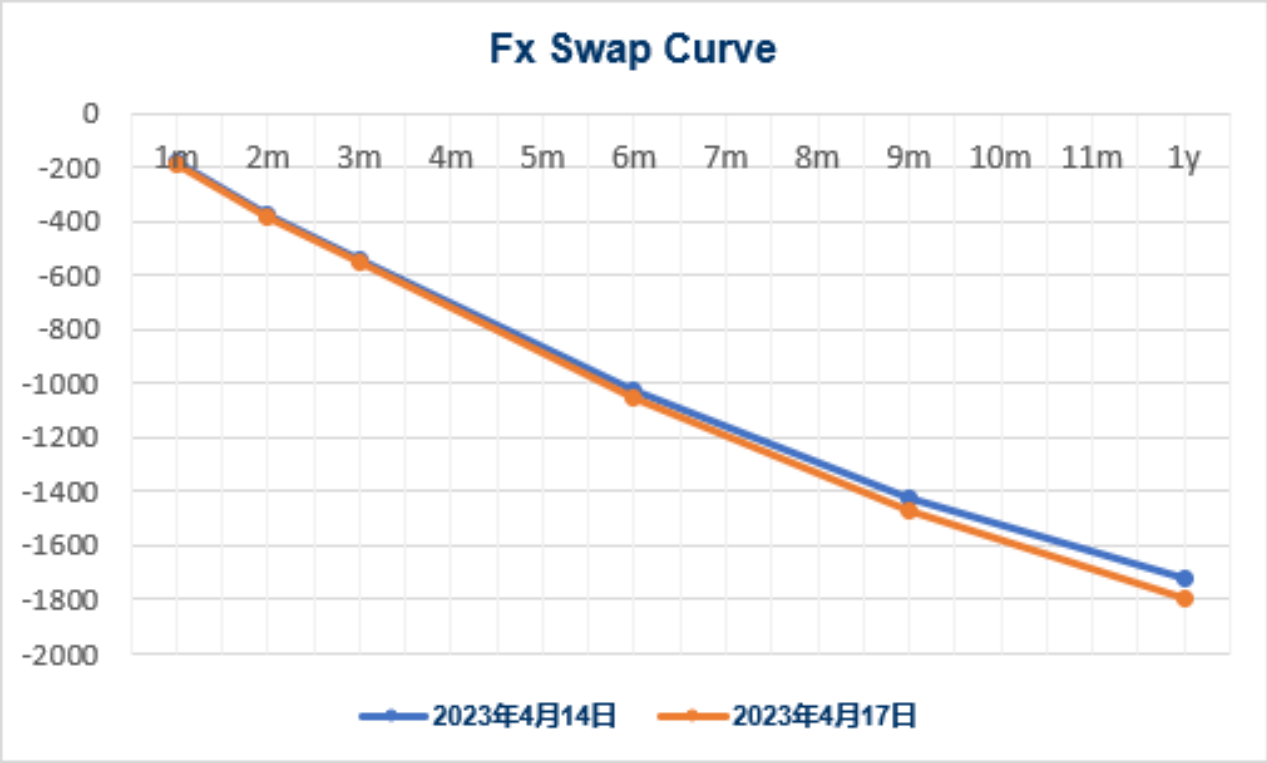
今日 Fixing 定在 6.8679，较上一交易日上调了 73 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 成交在-6.8~-6.22， T/N 成交在-6.19~-6.12， S/N 成交在-6.21~-6.18。1w 反复成交在-42.9， -42.85， -42.8 的位置； 2w 成交在-91 的位置； 1s 成交在-183.5 的位置； 2s 成交在-380， -375 的位置； 3s 成交在-554.5， -554， -552， -551， -550， -546， -545 的位置； 5s 成交在-888， -886， -885 的位置； 中长期， 6s 成交在-1052.5， -1048， -1045， -1044， -1042 的位置； 9s 成交在-1470， -1469， -1468， -1464 的位置； 1y 反复成交在-1800， -1798， -1797， -1785， -1776 的位置； 2y 成交在-2300 的位置；

Spread 上， 2s*3s 成交在-172， -171 的位置； 9s*1y 反复成交在-315,-312 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	6.8674	0.05
2W	15	-91	6.8626	5
1M	30	-184	6.8533	-3.7
2M	62	-380	6.8337	-3
3M	91	-551	6.8166	-9
6M	183	-1051	6.7666	-23
9M	275	-1475	6.7242	-50
1Y	366	-1795	6.6922	-70
18M	551	-2250	6.6467	-210
2Y	733	-2275	6.6442	-155
3Y	1097	-2400	6.6317	-230
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8679	
CLOSING SPOT RATE			6.8717	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-196	-367	-867	-1291	-1611
2M		-171	-671	-1095	-1415
3M			-500	-924	-1244
6M				-424	-744
9M					-320



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