



【2023-04-07】

今日 Fixing 定在 6.8838，较上一交易日上调了 91 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅下跌。

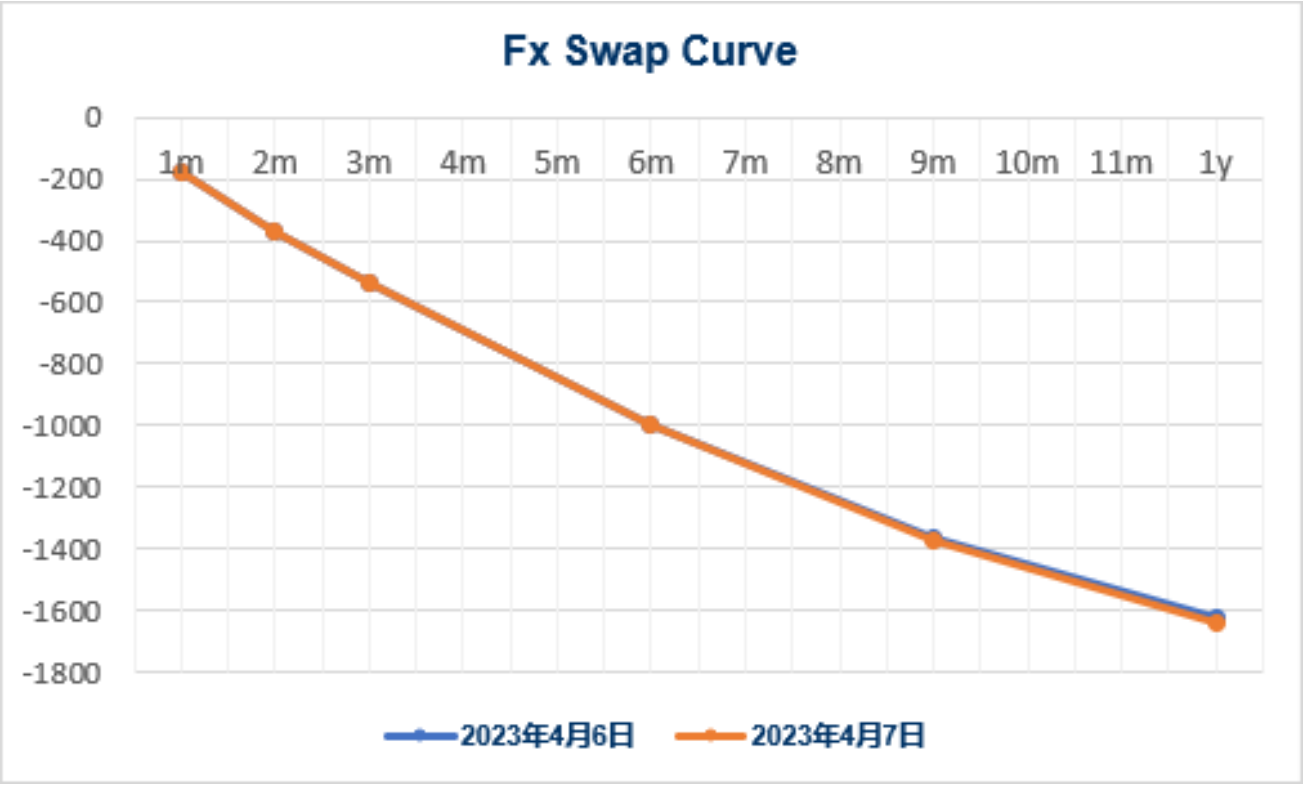
短端，O/N 成交在-20~-18.8。T/N 成交在-6.75~-6.15。S/N 成交在-6.3~-6.18。1w 成交在-43.3~-43。1s 成交在-180。3s 成交在-536~-535，尾盘收在-535。4s 成交在-702。

中长期，6s 成交在-1002~-999，尾盘收在-1000。9s 成交在-1378，-1377，-1375。1y 成交在-1640~-1633，尾盘收在-1639。

Spread 上，6*9s 成交在-377。9*12s 成交在-263。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	6.8711	-0.8
2W	14	-85	6.8669	-2
1M	30	-180	6.8574	-2
2M	62	-369	6.8385	1
3M	91	-535	6.8220	-0.5
6M	183	-999	6.7755	-1
9M	275	-1378	6.7376	-15
1Y	366	-1639	6.7115	-14
18M	549	-1925	6.6829	0
2Y	731	-1900	6.6854	-10
3Y	1098	-1950	6.6804	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8838	
CLOSING SPOT RATE			6.8754	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-189.4	-354.9	-819.4	-1198.4	-1459.4
2M		-165.5	-630	-1009	-1270
3M			-464.5	-843.5	-1104.5
6M				-379	-640
9M					-261



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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN