



【2023-03-31】

今日 Fixing 定在 6.8717，较上一交易日下调了 169 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅下跌。

短端，O/N 成交在-18~-14。T/N 成交在-6.45~-5.68。S/N 成交在-13~-12。1w 成交在-43~-41.8。2w 成交在-84，-83.5。1s 成交在-174~-171.5。2s 成交在-363~-361。3s 成交在-536~-532，尾盘收在-534。

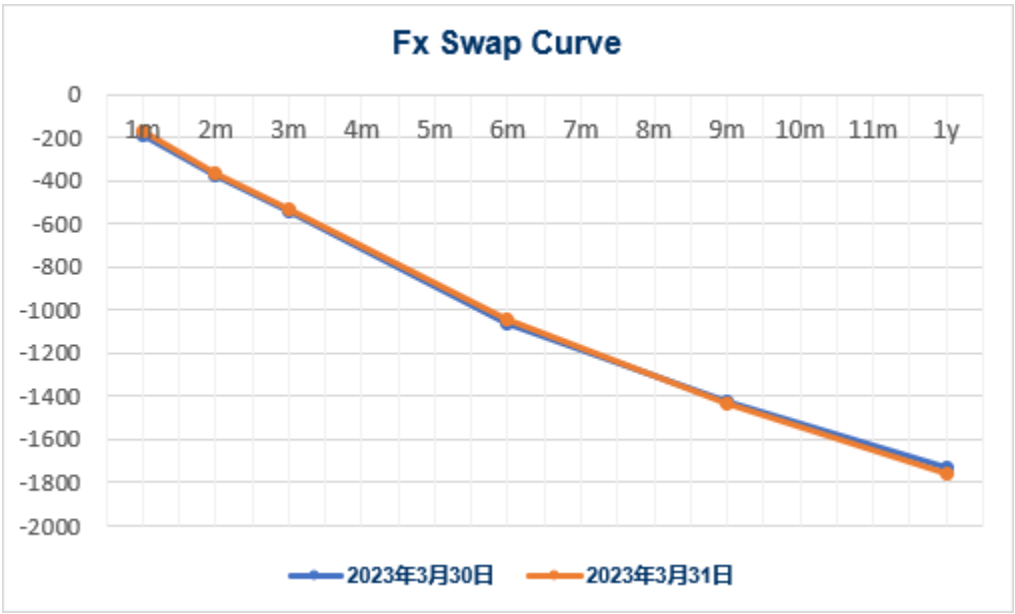
中长期限，6s 成交在-1042~-1037，尾盘收在-1045。9s 成交在-1430~-1414，最后成交-1430。1y 成交在-1750~-1733，尾盘收在-1750。

长期限上，2y 成交在-2185。

Spread 上，2*3s 成交在-172.5~-171。9*12s 成交在-315，-314。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-42	6.8671	4
2W	14	-84	6.8630	6
1M	30	-172	6.8541	14
2M	62	-361	6.8352	17
3M	92	-535	6.8178	4
6M	189	-1048	6.7665	12
9M	275	-1430	6.7283	-2
1Y	370	-1755	6.6958	-20
18M	533	-2100	6.6613	-25
2Y	734	-2220	6.6493	-50
3Y	1098	-2300	6.6413	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8717	
CLOSING SPOT RATE			6.8713	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-189	-363	-876	-1258	-1583
2M		-174	-687	-1069	-1394
3M			-513	-895	-1220
6M				-382	-707
9M					-325



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