



【2023-03-03】

今日 Fixing 定在 6.9117，较上一交易日上调了 309 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上涨。

短端，O/N 成交在-18.5~-17.8。T/N 成交在-6.4~-5.6。S/N 成交在-6.3~-5.7。1w 成交在-39~-37。2w 成交在-76~-73。3w 成交在-109， -108， -107。1s 成交在-156~-154。2s 成交在-317~-313。3s 成交在-480~-472，尾盘收在-472。

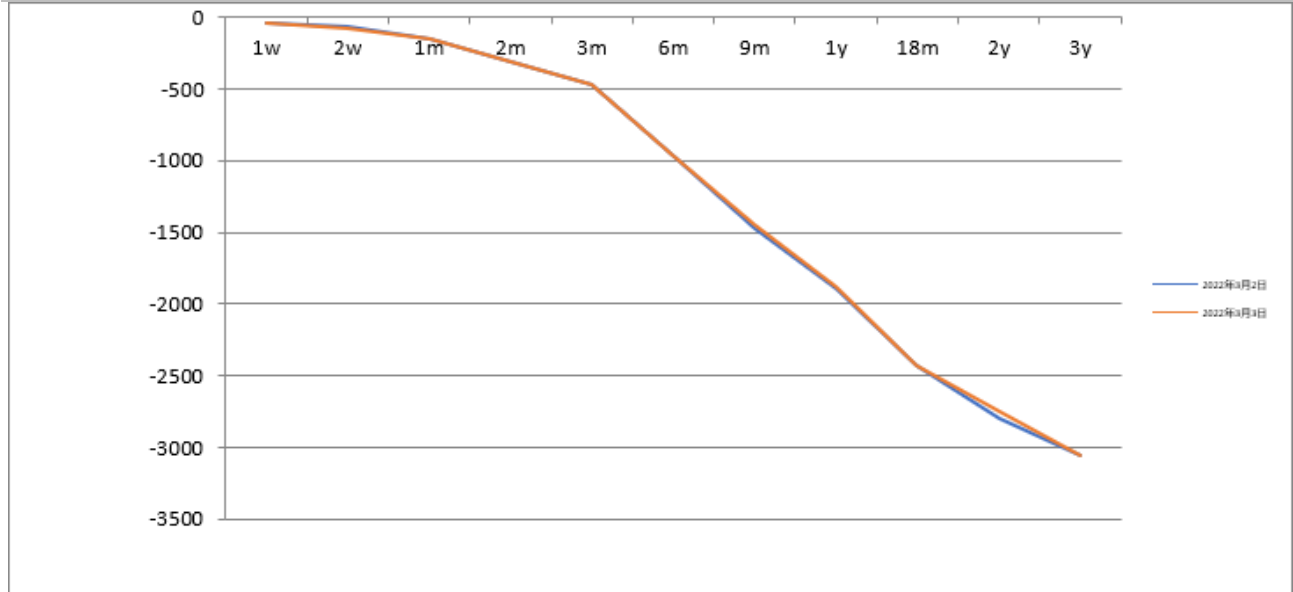
中长期限，6s 成交在-992~-975，尾盘收在-970。9s 成交在-1485。1y 成交在-1920~-1863，尾盘收在-1870。

长期限上，18s 成交在-2460。2y 成交在-2800， -2785， -2780， -2770， -2765。

Spread 上，1w*2w 成交 -36。2*3s 成交在-161， -160.5。3*6s 成交在-512。9*12s 成交在-425。12*18s 成交在-570。1y*2y 成交在-870。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	6.8964	-3
2W	14	-74	6.8929	-4
1M	32	-155	6.8848	-5
2M	63	-314	6.8688	-1
3M	92	-472	6.8530	-4
6M	187	-970	6.8032	5
9M	277	-1455	6.7547	18
1Y	368	-1875	6.7127	21
18M	551	-2430	6.6572	0
2Y	732	-2750	6.6252	50
3Y	1096	-3050	6.5952	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9117	
CLOSING SPOT RATE			6.9002	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-159.5	-317.5	-815.5	-1300.5	-1720.5
2M		-158	-656	-1141	-1561
3M			-498	-983	-1403
6M				-485	-905
9M					-420



文 /Jason Ge