



【2023-03-30】

今日 Fixing 定在 6.8886，较上一交易日上升了 115 个 bp。各期限收盘价较上一交易日略微有所上升，今日交投较活跃。

短端，O/N 主要成交在-7.7~-7.3。T/N 主要成交在-20.5~-19.2 的位置。S/N 主要成交在-7.1~-6.5 的位置。1w 成交在-47.5， -47.2， -47， -46.5， -46.3， -46.25， -46， -45.5， -45.2， -45.5， -45.8， -46 等位置。2w 成交在-91， -90， -89 等位置。3w 成交在-131 的位置。1s 成交在-194， -193.5， -193， -192， -191， -190， -189， -188.5， -186， -183， -186.5 的位置。2s 成交在-381， -380.5， -380， -378， -375， -374， -377 等位置。3s 成交在-551， -549， -547， -545， -543， -542， -540， -539， -537， -536， -535， -533， -537 等位置。

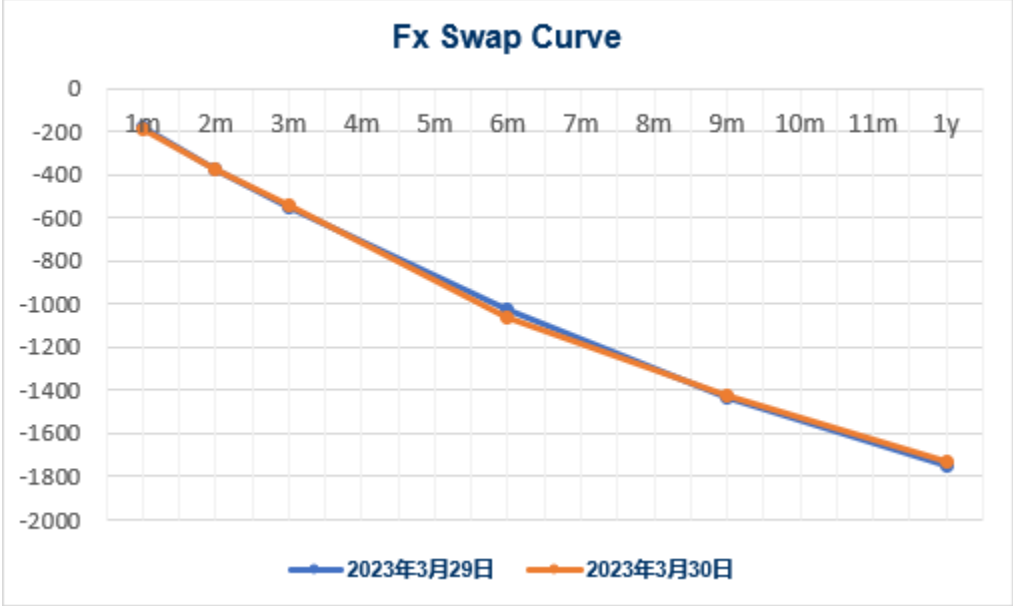
中长期，6s 成交在-1060， -1065， -1058， -1055， -1060 等位置。9s 成交在-1440， -1430， -1428 等位置。1y 成交在-1760， -1750， -1735， -1720， -1717， -1730 等位置。

超长方面，2y 成交在-2167 的位置。

Spread 方面，1s*2s 成交在-191.5， -190 的位置。2s*3s 成交在-161， -161.5， -162 的位置。9s*12s 成交在-300 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-46	6.8735	2.15
2W	14	-89	6.8692	4
1M	31	-186	6.8595	-7.9
2M	63	-378	6.8404	-5
3M	91	-539	6.8242	13.5
6M	190	-1060	6.7721	-32
9M	275	-1428	6.7353	7
1Y	366	-1735	6.7046	12
18M	554	-2075	6.6706	25
2Y	731	-2170	6.6611	10
3Y	1096	-2300	6.6481	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8886	
CLOSING SPOT RATE			6.8781	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-191.5	-353	-874	-1242	-1549
2M		-161.5	-682.5	-1050.5	-1357.5
3M			-521	-889	-1196
6M				-368	-675
9M					-307



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