



【2023-03-10】

今日 Fixing 定在 6.9655，较上一交易日下调了 11 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-17~-15.5。T/N 成交在-5.6~-5.4。S/N 成交在-5.5~-5.4。1w 成交在-39~-38.5。2w 成交在-79.5~-79。3w 成交在-111，-112，-113。1s 成交在-170~-165。2s 成交在-343~-338。3s 成交在-524~-510，尾盘收在-525。

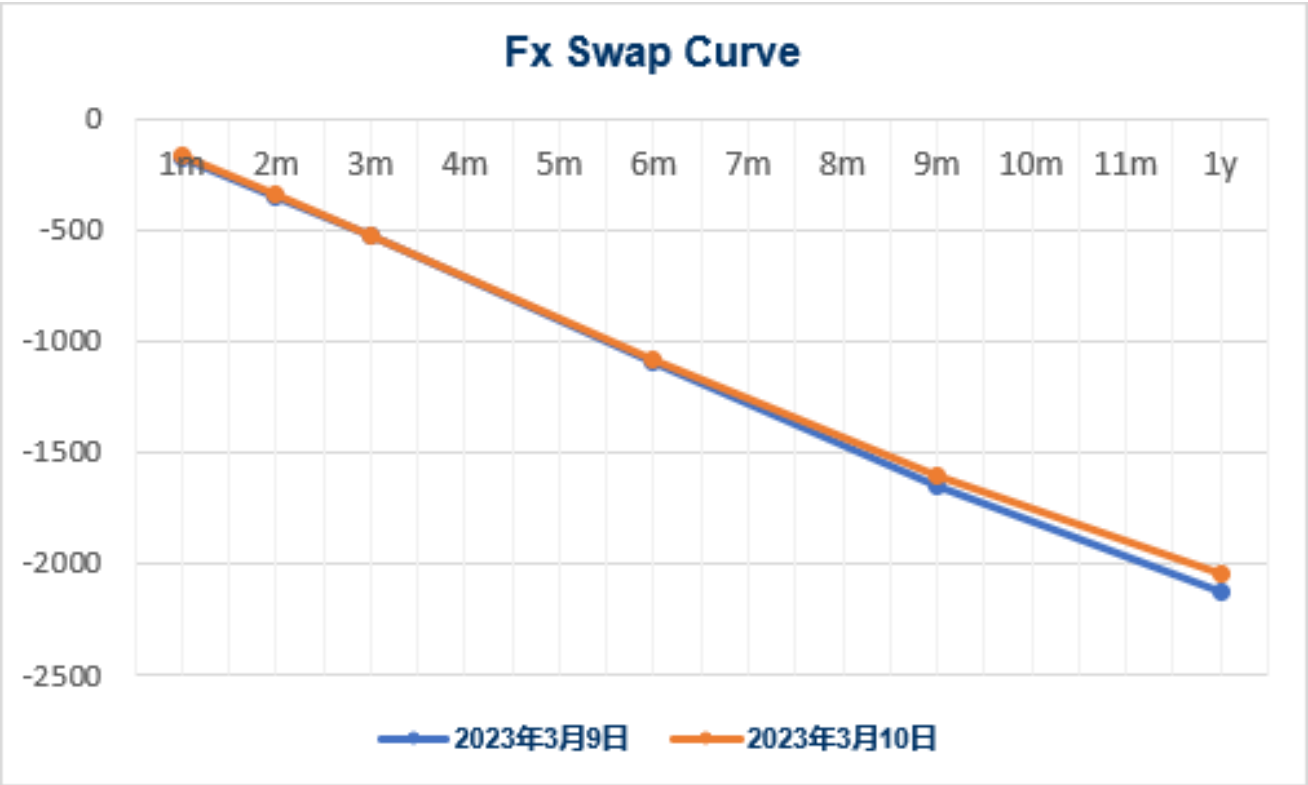
中长期限，6s 成交在-1090~-1050，尾盘收在-1088。9s 成交在-1595。1y 成交在-2070~-2015，尾盘收在-2068。

长期限上，18s 成交在-2615。2y 成交在-2980，-2950。

Spread 上，2*3s 成交在-178。3*6s 成交在-550。6*12s 成交在-975。1y*2y 成交在-930，-920。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	6.9614	1.45
2W	14	-80	6.9574	1
1M	31	-171	6.9483	2.5
2M	62	-345	6.9308	10
3M	92	-525	6.9129	6.5
6M	184	-1085	6.8568	16
9M	275	-1601	6.8052	50
1Y	366	-2052	6.7601	82
18M	552	-2660	6.6993	170
2Y	731	-2980	6.6673	220
3Y	1098	-3200	6.6453	200
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9655	
CLOSING SPOT RATE			6.9653	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-174.5	-354	-914.5	-1430.5	-1881.5
2M		-179.5	-740	-1256	-1707
3M			-560.5	-1076.5	-1527.5
6M				-516	-967
9M					-451



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

禁止处理涉密信息和内部敏感信息