



【2023-03-09】

今日 Fixing 定在 6.9666，较上一交易日上升了 141 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所下降。

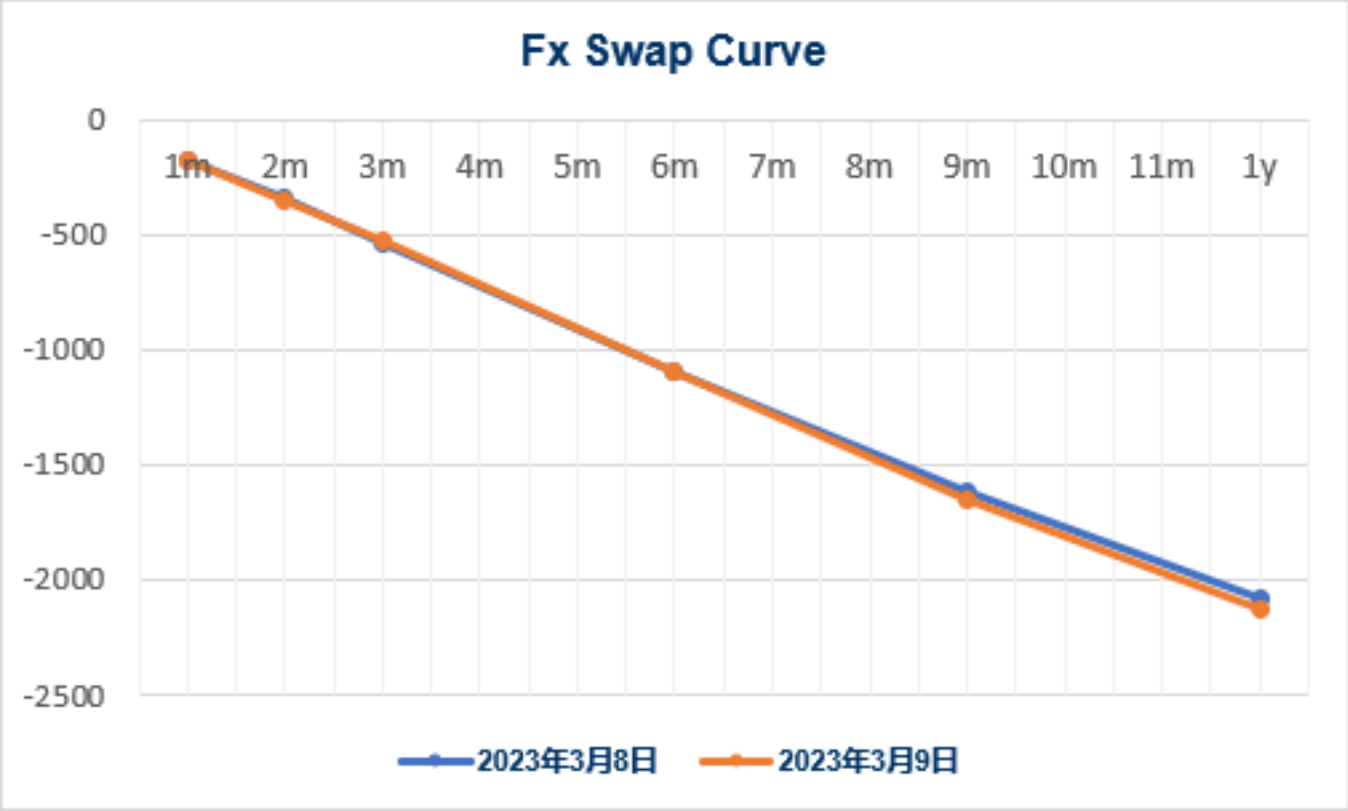
短端，O/N 主要成交在-6.1~-5.6。T/N 主要成交在-18.1~-17.15 的位置。S/N 主要成交在-5.9~-5.75 的位置。1w 成交在-40.3, -40.5, -40.7, -40.8, -40.65, -40.6, -40.55, -40.5, -40.45 等位置。2w 成交在-80, -79.5, -79 等位置。1s 成交在-174, -173, -176, -176.5, -176, -175.5, -175, -174, -173, -173.5, -172 的位置。2s 成交在-355, -360, -362, -363, -360, -361, -358, -355 等位置。3s 成交在-540, -545, -543, -544, -542, -541, -540, -537, -535, -532, -530 等位置。4s 成交在-710 的位置。

中长期限，6s 成交在-1100, -1105, -1115, -1120, -1118, -1116, -1112, -1108, -1105, -1104, -1102, -1101 等位置。9s 成交在-1640, -1650, -1655, -1660, -1663, -1658, -1650, -1651, -1646 等位置。1y 成交在-2100, -2110, -2118, -2120, -2135, -2120, -2137, -2133, -2145, -2150, -2145, -2150, -2140, -2135 等位置。

Spread 方面，1w*2w 成交在-39 的位置。1s*2s 成交在-185 的位置。3s*6s 成交在-575 的位置。9s*12s 成交在-480, -485 的位置。1y*2y 成交在-1050 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	6.9659	1.15
2W	14	-80	6.9619	-1
1M	31	-173	6.9526	-0.2
2M	63	-355	6.9344	-13
3M	92	-531	6.9168	9
6M	184	-1101	6.8598	-4
9M	275	-1651	6.8048	-30
1Y	366	-2134	6.7565	-47
18M	550	-2830	6.6869	-80
2Y	731	-3200	6.6499	-140
3Y	1096	-3400	6.6299	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9666	
CLOSING SPOT RATE			6.9699	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-182	-358	-928	-1478	-1961
2M		-176	-746	-1296	-1779
3M			-570	-1120	-1603
6M				-550	-1033
9M					-483



文/ Yiff Wang

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