



【2023-03-16】

今日 Fixing 定在 6.9149，较上一交易日上升了 469 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端， O/N 主要成交在-5~-4.2。T/N 主要成交在-18.3~-15.4 的位置。S/N 主要成交在-6~-5.3 的位置。1w 成交在-42.5， -42， -41.7， -41.5， -41.3 等位置。2w 成交在-82， -83， -82.8， -82.5 等位置。3w 成交在-124 的位置。1s 成交在-185， -184， -183， -183.5， -182， -180.5， -180 的位置。2s 成交在-366， -369， -368， -367， -365 等位置。3s 成交在-530， -532， -533， -531， -529， -528， -527， -525 等位置。4s 成交在-669， -670 的位置。

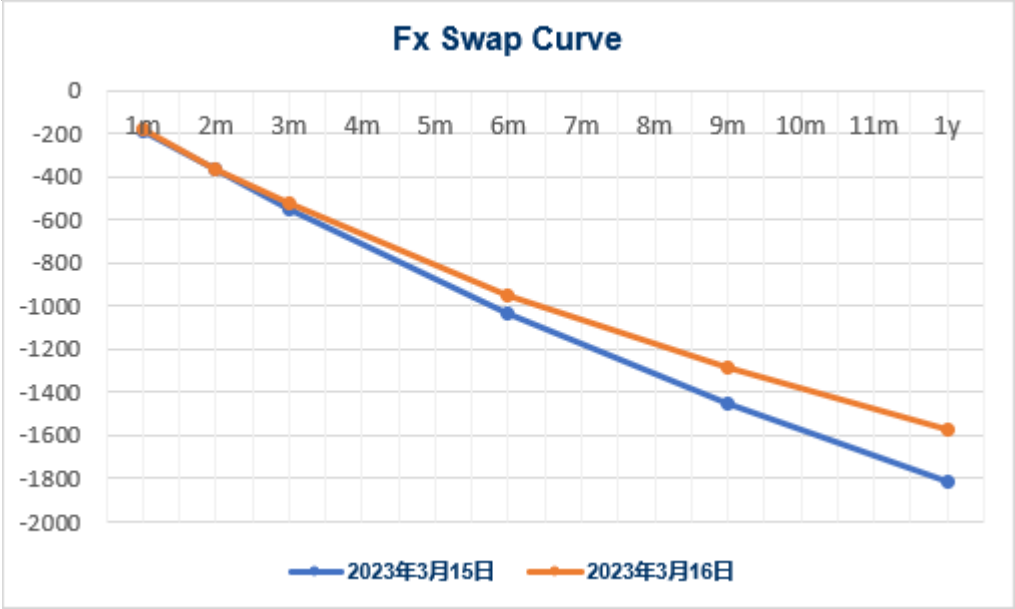
中长期限， 6s 成交在-945， -950， -951， -953， -955， -957， -963， -960， -955 等位置。9s 成交在-1286， -1290， -1297， -1300， -1296 等位置。1y 成交在-1530， -1490， -1540， -1570， -1600， -1580， -1561， -1569， -1572， -1588， -575， -1569， -1585 等位置。

超长方面， 18s 成交在-1930 的位置。2y 成交在-2100 的位置。

Spread 方面， 1w\*2w 成交在-41 的位置。2w\*1s 成交在-102 的位置。3w\*1s 成交在-58， -57 的位置。2s\*3s 成交在-160 的位置。1\*3s 成交在-347 的位置。3s\*6s 成交在-420 的位置。6s\*12s 成交在-626 的位置。12s\*18s 成交在-370， -380 的位置。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 7    | -41        | 6.8977       | 1.55       |
| 2W                      | 14   | -83        | 6.8936       | 3          |
| 1M                      | 31   | -180       | 6.8838       | 7          |
| 2M                      | 63   | -365       | 6.8653       | -4         |
| 3M                      | 92   | -524       | 6.8494       | 31         |
| 6M                      | 184  | -948       | 6.8070       | 87         |
| 9M                      | 275  | -1287      | 6.7731       | 163        |
| 1Y                      | 366  | -1575      | 6.7443       | 236        |
| 18M                     | 550  | -1940      | 6.7078       | 295        |
| 2Y                      | 731  | -2120      | 6.6898       | 365        |
| 3Y                      | 1096 | -2425      | 6.6593       | 325        |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 6.9149       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 6.9018       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |      |      |      |       |       |
|---------------------|------|------|------|-------|-------|
|                     | 2M   | 3M   | 6M   | 9M    | 1Y    |
| 1M                  | -185 | -344 | -768 | -1107 | -1395 |
| 2M                  |      | -159 | -583 | -922  | -1210 |
| 3M                  |      |      | -424 | -763  | -1051 |
| 6M                  |      |      |      | -339  | -627  |
| 9M                  |      |      |      |       | -288  |



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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)**