



【2023-03-24】

今日 Fixing 定在 6.8374，较上一交易日下调了 335 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-19.5~-19。T/N 成交在-6.8~-6.3。S/N 成交在-6.8~-6.3。1w 成交在-46.3~-44.3。2w 成交在-89.5~-89。3w 成交在-134， -132。1s 成交在-193~-190.5。2s 成交在-381。3s 成交在-545~-541，尾盘收在-543。

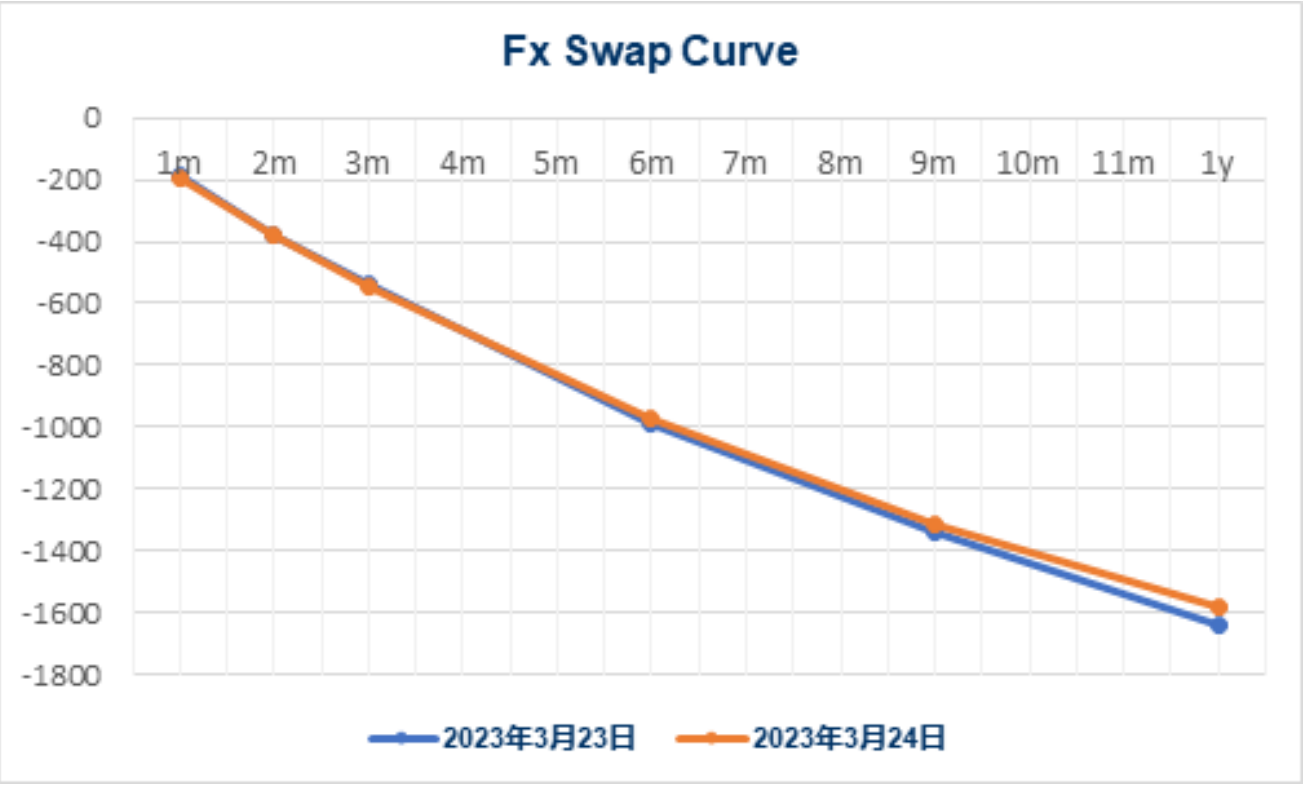
中长期，6s 成交在-988~-975，尾盘收在-975。9s 成交在-1328~-1325。1y 成交在-1610~-1574，尾盘收在-1574。

长期限上，2y 成交在-1950， -1865。3y 成交在-2050， -2000。

Spread 上，2w*3w 成交在-42.5。3w*1s 成交在-60。3*6s 成交在-442。6*9s 成交在-340。9*12s 成交在-282， -284。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-46	6.8609	-2.8
2W	14	-90	6.8565	-4
1M	31	-191	6.8464	-4
2M	63	-381	6.8274	-1
3M	92	-543	6.8113	-5.5
6M	184	-975	6.7680	13
9M	275	-1316	6.7339	26.5
1Y	366	-1580	6.7075	60
18M	552	-1850	6.6805	100
2Y	731	-1900	6.6755	165
3Y	1098	-2000	6.6655	250
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8374	
CLOSING SPOT RATE			6.8655	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-190	-351.5	-784	-1125	-1389
2M		-161.5	-594	-935	-1199
3M			-432.5	-773.5	-1037.5
6M				-341	-605
9M					-264



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