



【2023-02-03】

今日 Fixing 定在 6.7382，较上一交易日上调了 252 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅下跌。

短端，O/N 成交在-14~-13.5。T/N 成交在-4.6~-4.5。S/N 成交在-4.8~-4.6。1w 成交在-32.9~-32。1s 成交在-129.5~-125。2s 成交在-261~-260。3s 成交在-401~-396，尾盘收在-401。

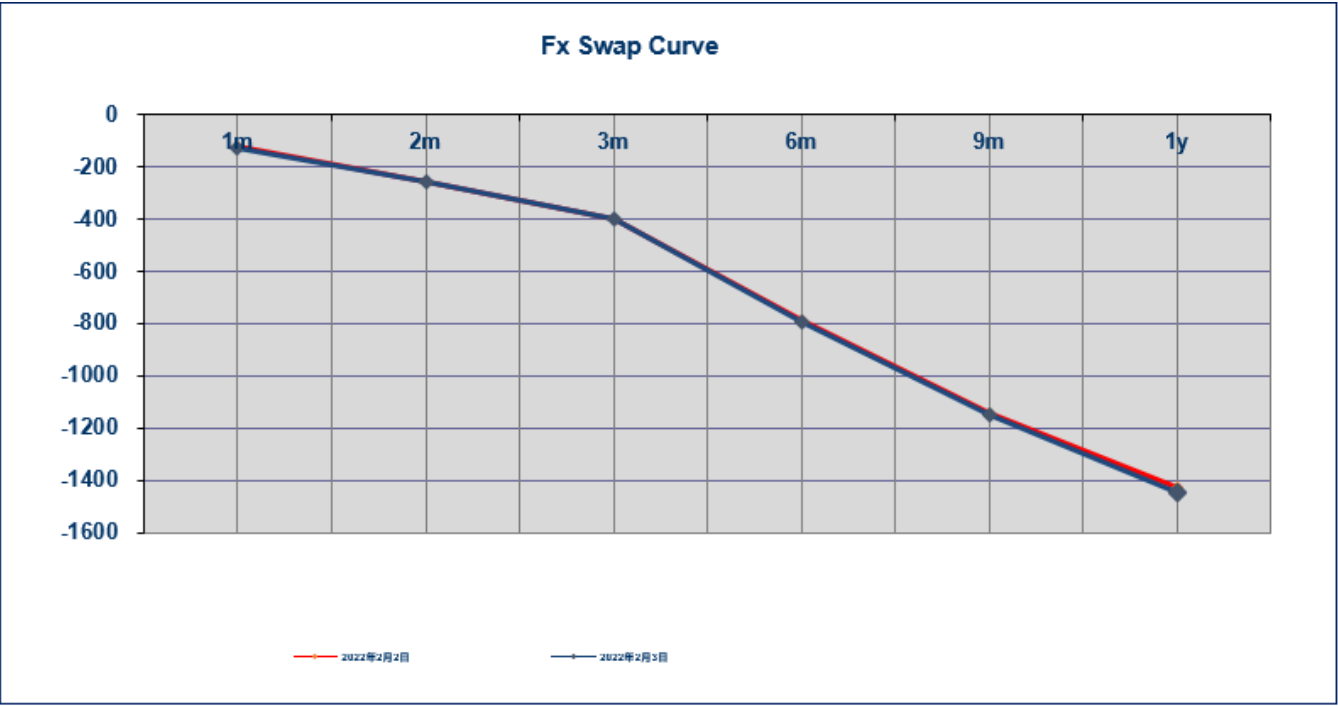
中长期限，6s 成交在-795~-785，尾盘收在-795。9s 成交在-1150，-1145。1y 成交在-1450~-1435，尾盘收在-1450。

长期限上，18s 成交-1700。

Spread 上，3*6s 成交在-390。6*9s 成交在-355。6*12s 成交在-655。12*18s 成交在-260，-250。18*24s 成交在-50。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-32	6.7433	-2.11
2W	14	-64	6.7401	2
1M	28	-126	6.7339	-2.2
2M	59	-261	6.7204	-2
3M	90	-401	6.7065	1
6M	181	-795	6.6670	-5
9M	273	-1150	6.6315	-9
1Y	365	-1450	6.6015	-20
18M	547	-1700	6.5765	0
2Y	731	-1740	6.5725	10
3Y	1098	-1740	6.5725	-40
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7328	
CLOSING SPOT RATE			6.7465	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-135	-274.5	-669	-1024	-1324
2M		-139.5	-534	-889	-1189
3M			-394.5	-749.5	-1049.5
6M				-355	-655
9M					-300



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