



【2023-02-13】

今日 Fixing 定在 6.8151，较上一交易日上调了 267 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 成交在-5.2~-4.75， T/N 成交在-4.8~-4.73， S/N 成交在-4.78~-4.71。1w 成交在-33.7， -33.4， -33.3， -33.2， -33.1 的位置；

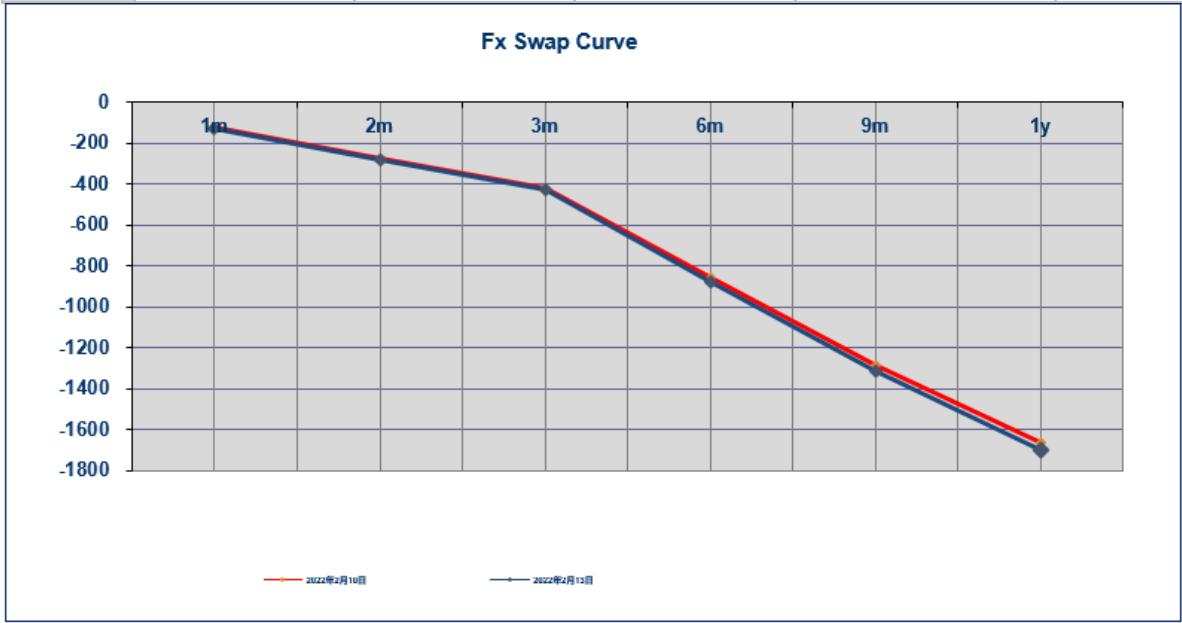
2s 反复成交在-290 的位置， 3s 反复成交在-430 的位置；

中长期限，6s 成交在-890， -888， -886， -885， -883 的位置； 9s 成交在-1335， -1333， -1331.5， -1330， -1327 的位置； 1y 反复成交在-1730， -1729， -1728， -1727， -1726， -1724 的位置，尾盘落在-1725 的位置； 2y 成交在-2350， -2330 的位置；

Spread 上， 9s*1y 成交在-394 的位置， 12s*18s 成交在-450 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	6.8238	-0.44
2W	14	-64	6.8207	2
1M	28	-128	6.8143	-1.2
2M	61	-287	6.7985	-14
3M	89	-426	6.7845	-5
6M	181	-883	6.7388	-23
9M	273	-1314	6.6957	-24
1Y	366	-1700	6.6571	-34
18M	547	-2180	6.6091	-95
2Y	734	-2330	6.5941	-120
3Y	1104	-2350	6.5921	-120
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8151	
CLOSING SPOT RATE			6.8271	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-158.3	-297.8	-754.8	-1185.8	-1571.8
2M		-139.5	-596.5	-1027.5	-1413.5
3M			-457	-888	-1274
6M				-431	-817
9M					-386



文 / Ray Yan

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