



【2023-02-24】

今日 Fixing 定在 6.8942，较上一交易日下调了 86 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅下跌。

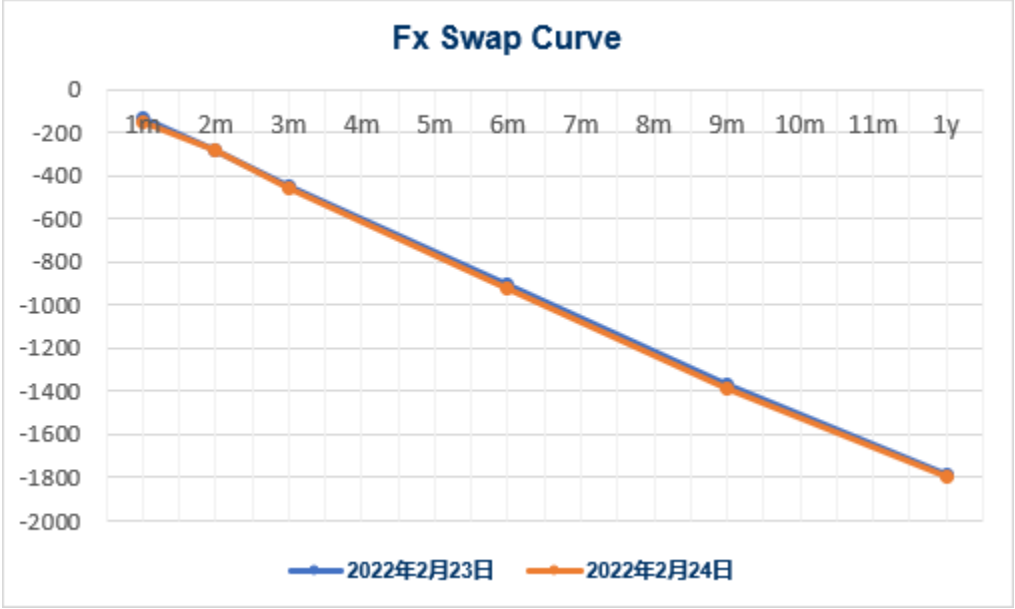
短端，O/N 成交在-18~-17。S/N 成交在-4.7~-4.5。1w 成交在-33.8~-32.5。2w 成交在-66.65~-64.5。3w 成交在-100， -97。1s 成交在-148~-146。2s 成交在-287~-283。3s 成交在-460~-456，尾盘收在-456。

中长期，6s 成交在-930~-922，尾盘收在-927。9s 成交在-1390~-1385。1y 成交在-1800~-1780，尾盘收在-1794。

Spread 上，1w*2w 成交 -33。3w*1s 成交在-49.3。1*2s 成交在-137。6*12s 成交在-866， -865， -863。1y*2y 成交在-730。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	6.9409	-0.5
2W	14	-65	6.9377	-1
1M	28	-147	6.9295	-16
2M	59	-285	6.9157	-5
3M	92	-456	6.8986	-7
6M	184	-927	6.8515	-19
9M	275	-1388	6.8054	-20
1Y	366	-1795	6.7647	-10
18M	549	-2305	6.7137	-5
2Y	731	-2540	6.6902	-25
3Y	1095	-2730	6.6712	-15
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8942	
CLOSING SPOT RATE			6.9442	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-138	-309	-780	-1241	-1648
2M		-171	-642	-1103	-1510
3M			-471	-932	-1339
6M				-461	-868
9M					-407



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