



【2023-02-23】

今日 Fixing 定在 6.9028，较上一交易日上升了 269 个 bp。各期限收盘价较上一交易日略微有所下降。

短端，O/N 主要成交在-6.2~-5。T/N 主要成交在-16~-14.9 的位置。S/N 主要成交在-5.1~-4.8 的位置。1w 成交在-32.5， -32.4， -32.3， -32.2， -32.1， -32 等位置。2w 成交在-63.5， -63.8 等位置。3w 成交在-97 的位置。1s 成交在-130， -129.5， -130.5 的位置。2s 成交在-283， -281， -280， -279.5 等位置。3s 成交在-450， -451， -449， -448， -448.5 等位置。

中长期，6s 成交在-905， -906， -910， -912， -907 等位置。9s 成交在-1360， -1355， -1351， -1360， -1365， -1670， -1366 等位置。1y 成交在-1800， -1785， -1780， -1770， -1785， -1788， -1790， -1792， -1787， -1785 等位置。

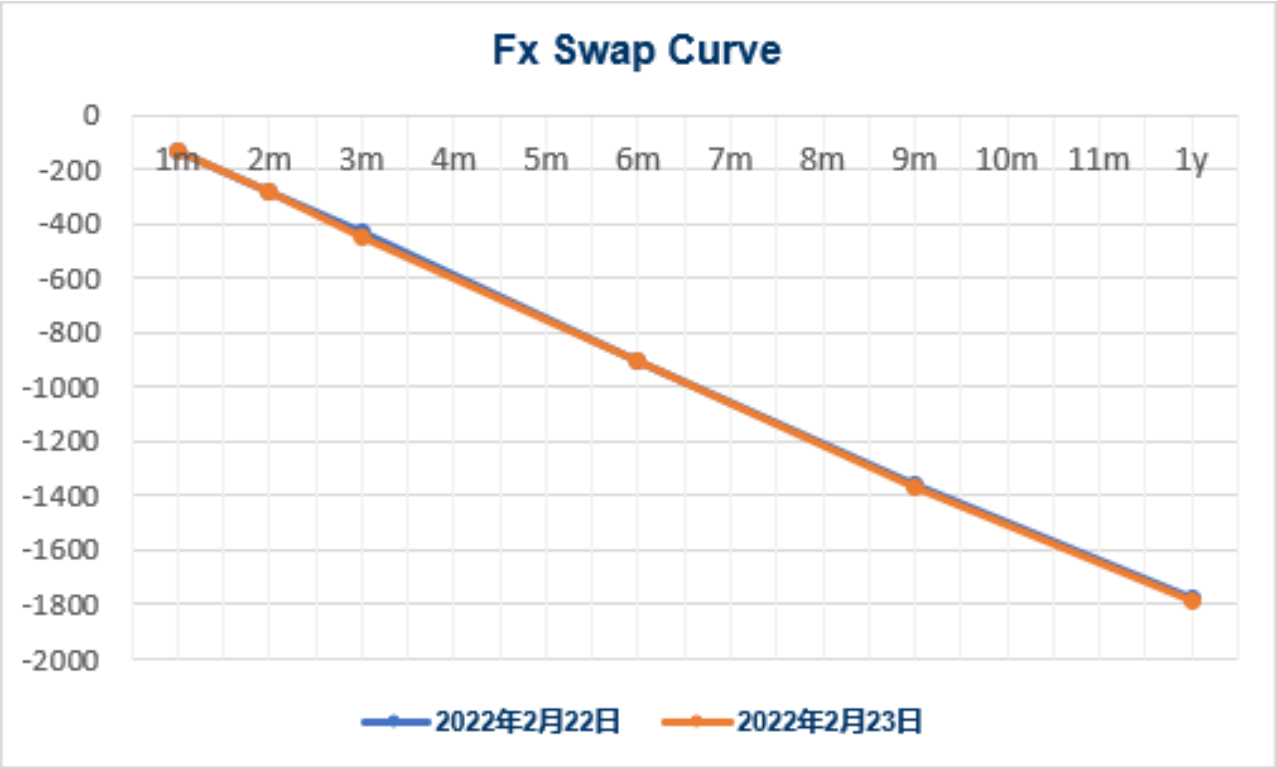
超长方面，2y 成交在-2535， -2530， -2525， -2520， -2515 的位置。

Spread 方面，1w*2w 成交在-31.6 的位置。1w*3w 成交在-65 的位置。1s*2s 成交在-150 的位置。2s*3s 成交在-167 的位置。1s*3s 成交在-317 的位置。3s*6s 成交在-456 的位置。6s*9s 成交在-455， -457， -460 的位置。6s*12s 成交在-875， -873， -880 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-32	6.8886	-0.4
2W	14	-64	6.8854	0
1M	28	-131	6.8787	-1.5
2M	59	-280	6.8638	1
3M	92	-449	6.8469	-18
6M	182	-908	6.8010	-8
9M	273	-1368	6.7550	-13
1Y	365	-1785	6.7133	-10
18M	547	-2300	6.6618	-50
2Y	731	-2515	6.6403	15
3Y	1096	-2715	6.6203	-15
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9028	
CLOSING SPOT RATE			6.8918	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-149	-318	-777	-1237	-1654
2M		-169	-628	-1088	-1505
3M			-459	-919	-1336

6M				-460	-877
9M					-417



文 / Yiff Wang

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