



【2023-01-30】

今日 Fixing 定在 6.7626，较上一交易日下调了 76 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端，O/N 成交在-4.4~-4， T/N 成交在-4.3~-3.15， S/N 成交在-4.1~-3.65。1w 反复成交在-28.4， -27.5 的位置； 2w 成交在-57， -56 的位置；

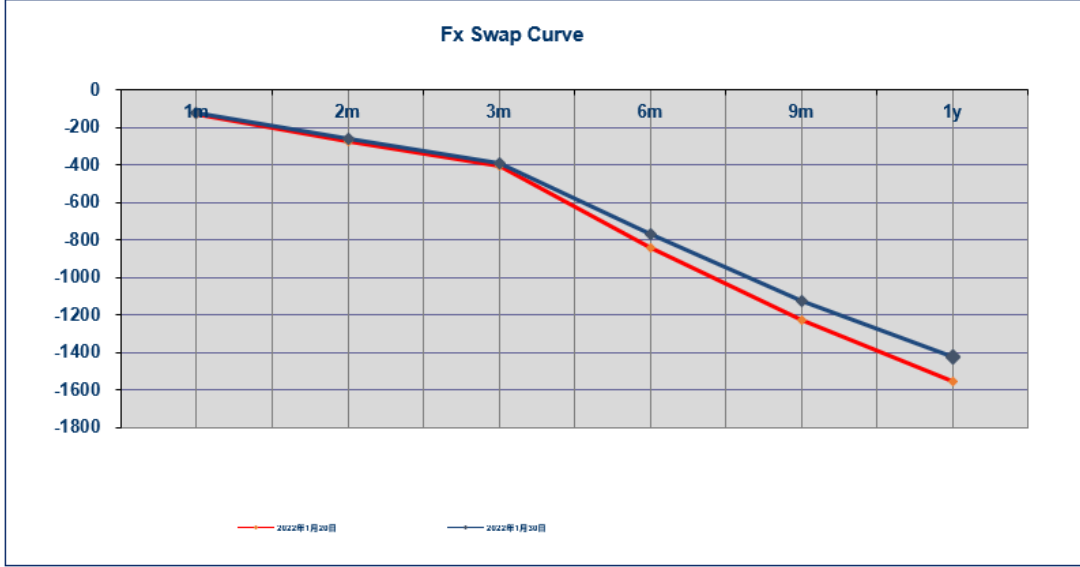
1s 反复成交在-120 的位置， 2s 成交在-260， -257 的位置， 3s 成交在-387， -385， -380 的位置；

中长期限， 9s 成交在-1125 的位置； 1y 成交在-1440， -1430， -1424， -1423， -1415， -1410 的位置； 2y 成交在-1685.5， -1670 的位置；

Spread 上， 2s*3s 成交在-127， -125 的位置； 9s*1y 成交在-294 的位置； 1y*2y 成交在-265， -260 的位置； 2y*3y 成交在 50， 30 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-29	6.7485	2
2W	14	-60	6.7455	6
1M	28	-122	6.7392	12
2M	61	-260	6.7254	15
3M	92	-389	6.7125	16
6M	181	-767	6.6747	73
9M	273	-1130	6.6384	100
1Y	365	-1425	6.6089	130
18M	547	-1700	6.5814	80
2Y	734	-1675	6.5839	75
3Y	1097	-1620	6.5894	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7626	
CLOSING SPOT RATE			6.7514	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-138	-267	-645	-1008	-1303
2M		-129	-507	-870	-1165
3M			-378	-741	-1036
6M				-363	-658
9M					-295



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