



【2023-02-17】

今日 Fixing 定在 6.8659，较上一交易日上调了 140 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅下跌。

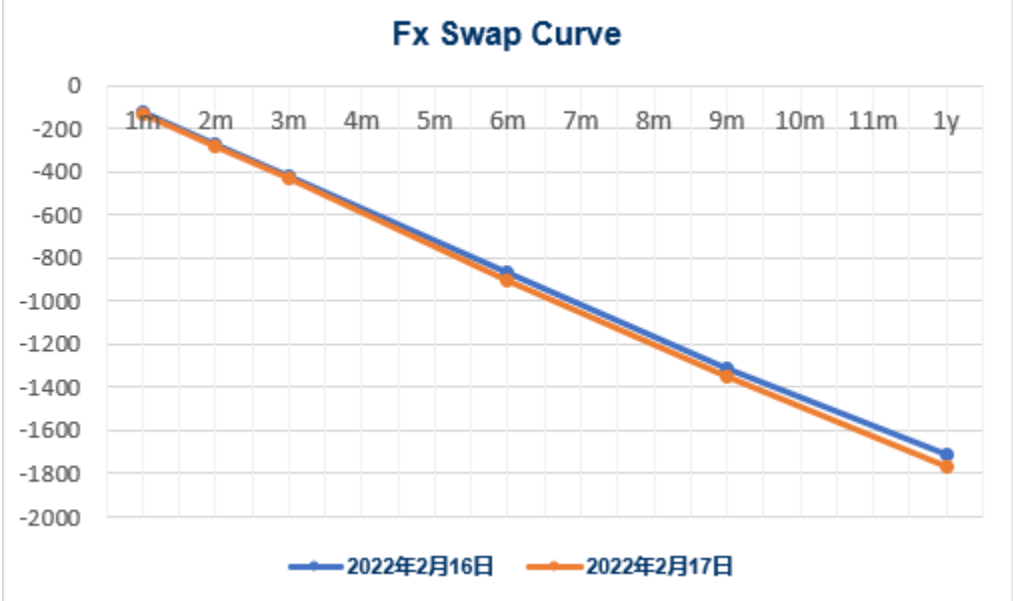
短端，O/N 成交在-17~-16.2。S/N 成交在-4.8~-4.65。1w 成交在-32.7~-32。2w 成交在-63.5~-62。1s 成交在-129~-128。2s 成交在-277~-275。3s 成交在-434~-425，尾盘收在-434。

中长期，6s 成交在-900~-880，尾盘收在-900。9s 成交在-1350~-1338。1y 成交在-1770~-1738，尾盘收在-1770。

Spread 上，3*6s 成交在-453。6*12s 成交在-864。9*12s 成交在-410。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	6.8785	-0.9
2W	14	-64	6.8754	-3
1M	28	-129	6.8689	-2.3
2M	59	-278	6.8540	-7
3M	90	-435	6.8384	-13.5
6M	181	-904	6.7914	-36
9M	273	-1353	6.7465	-43
1Y	365	-1769	6.7049	-59
18M	547	-2300	6.6518	-100
2Y	731	-2500	6.6318	-110
3Y	1098	-2550	6.6268	-70
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8659	
CLOSING SPOT RATE			6.8818	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-149	-305.5	-775	-1224	-1640
2M		-156.5	-626	-1075	-1491
3M			-469.5	-918.5	-1334.5
6M				-449	-865
9M					-416



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