



【2023-02-10】

今日 Fixing 定在 6.7884，较上一交易日下调了 21 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-14.55~-14.5。T/N 成交在-4.74~-4.5。S/N 成交在-4.8~-4.6。1w 成交在-33.5~-32.8。2w 成交在-66.5， -66， -67。1s 成交在-132~-127。2s 成交在-285~-273。3s 成交在-437~-421，尾盘收在-421。

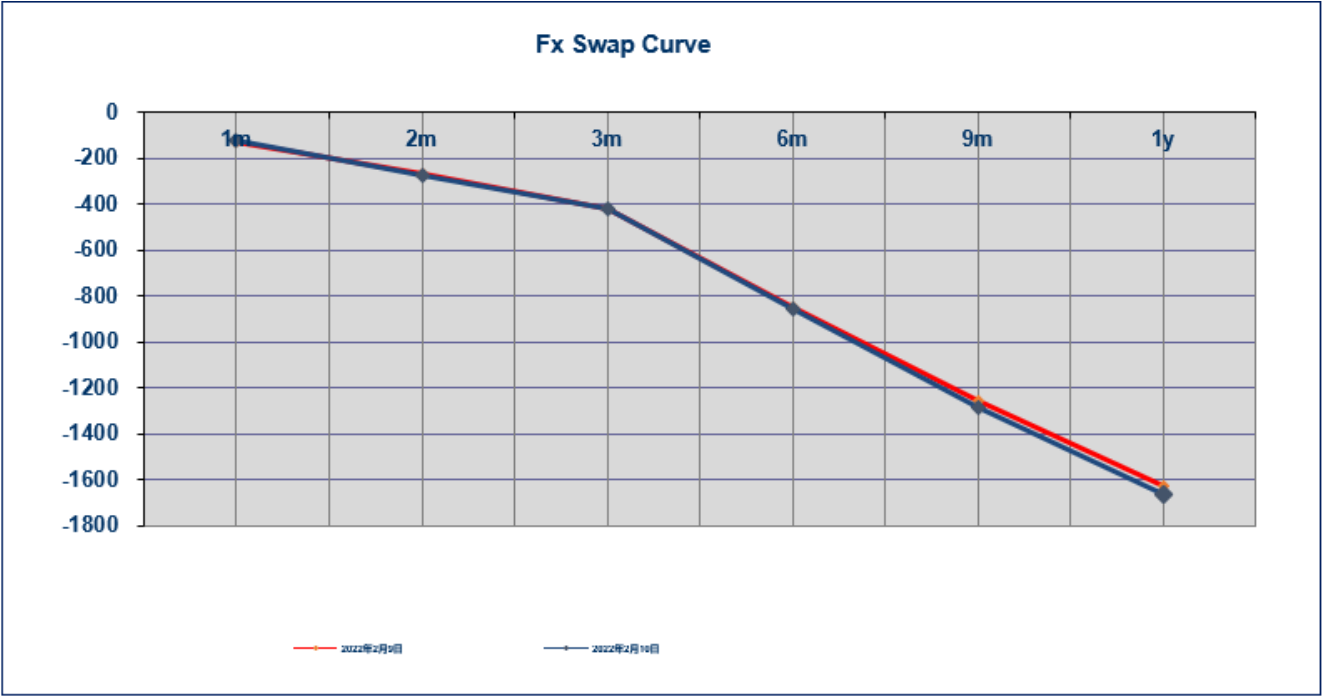
中长期，6s 成交在-880~-860，尾盘收在-860。9s 成交在-1308~-1302。1y 成交在-1688~-1668，尾盘收在-1670。

长期限上，2y 成交在-2240， -2210。

Spread 上，2*3s 成交在-149。3*6s 成交在-446。6*12s 成交在-812~-806。1y*2y 成交在-540。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	6.7966	2.74
2W	14	-66	6.7933	-2
1M	28	-127	6.7872	1
2M	59	-273	6.7726	-1
3M	90	-421	6.7578	-3
6M	181	-860	6.7139	-7
9M	273	-1290	6.6709	-30
1Y	367	-1666	6.6333	-36
18M	547	-2085	6.5914	-50
2Y	731	-2210	6.5789	-75
3Y	1105	-2230	6.5769	-84
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7884	
CLOSING SPOT RATE			6.7999	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-146	-294	-733	-1163	-1539
2M		-148	-587	-1017	-1393
3M			-439	-869	-1245
6M				-430	-806
9M					-376



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