



【2023-02-06】

今日 Fixing 定在 6.7737，较上一交易日上调了 355 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下降。

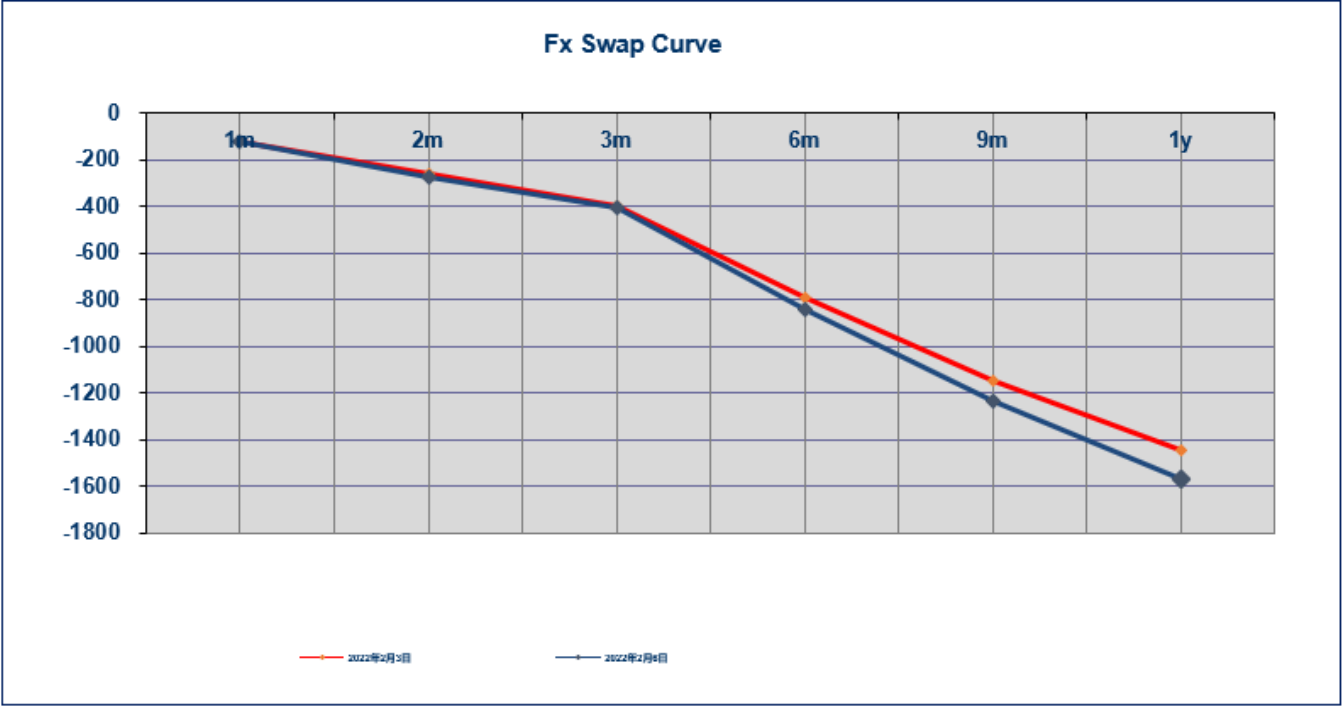
短端，O/N 成交在-4.9~-4.2， T/N 成交在-4.6~-4.35， S/N 成交在-4.53~-4.4。1w 成交在-31，反复成交在-31.5 的位置； 2w 成交在-61.7 的位置； 1s 成交在-130， -129 的位置， 2s 反复成交在-276 的位置， 3s 成交在-415， -413 的位置；

中长期限， 6s 成交在-842， -840， -838， -835 的位置； 9s 成交在-1231， -1225 的位置； 1y 反复成交在-1570， -1567， -1565， -1560， -1555， -1550， -1545， -1531， -1530 的位置； 2y 成交在-1900， -1880 的位置；

Spread 上， 1s*2s 成交在-151 的位置； 2s*3s 反复成交在-134 的位置； 6s*9s 成交在-390 的位置； 6s*1y 成交在-718 的位置； 1y*2y 成交在-380 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-31	6.7801	1.3
2W	14	-61	6.7771	3
1M	28	-126	6.7706	0
2M	61	-276	6.7557	-15
3M	89	-410	6.7422	-9.5
6M	181	-843	6.6989	-48
9M	273	-1234	6.6598	-84
1Y	365	-1571	6.6261	-121
18M	547	-1910	6.5922	-210
2Y	733	-1960	6.5872	-220
3Y	1097	-1950	6.5882	-210
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7737	
CLOSING SPOT RATE			6.7832	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-149.5	-284	-717	-1108	-1445
2M		-134.5	-567.5	-958.5	-1295.5
3M			-433	-824	-1161
6M				-391	-728
9M					-337



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