



【2023-02-01】

今日 Fixing 定在 6.7492，较上一交易日下调了 112 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅下跌。

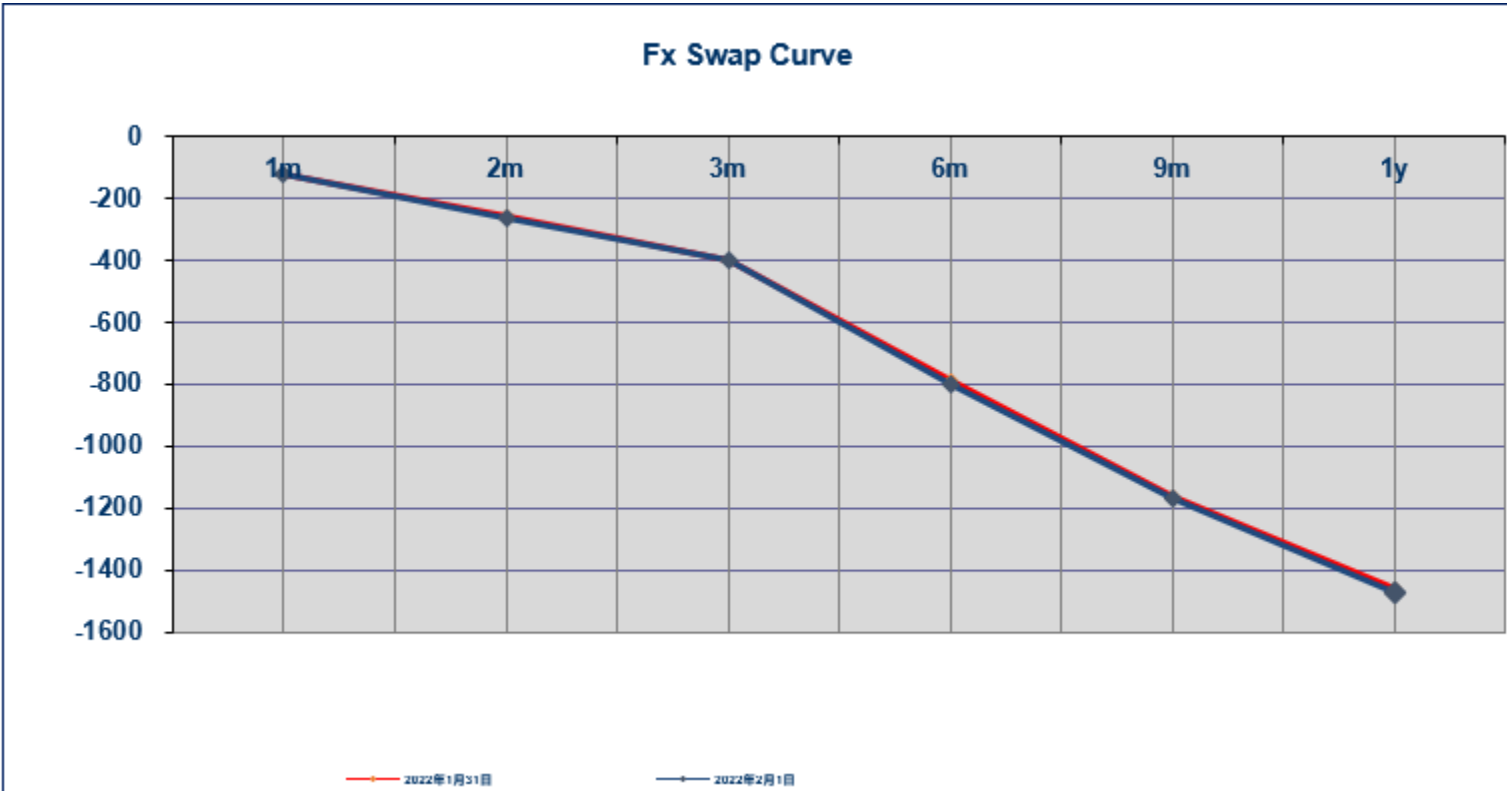
短端，O/N 成交在-4~-3.7。T/N 成交在-4~-3.6。S/N 成交在-12.2~-11.9。1w 成交在-30~-29。1s 成交在-126~-124。2s 成交在-265~-262。3s 成交在-408~-400，尾盘收在-402。4s 成交在-553。

中长期限，6s 成交在-813~-800，尾盘收在-802。9s 成交在-1180， -1178， -1175。1y 成交在-1495~-1470，尾盘收在-1470。

Spread 上， 2*3s 成交在-138。3*6s 成交在-400。6*12s 成交在-677。3*12s 成交在-1074。1*2y 成交-350。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-29	6.7381	-0.5
2W	14	-60	6.7350	0
1M	28	-125	6.7285	-3.8
2M	59	-262	6.7148	-1
3M	90	-402	6.7008	0.5
6M	181	-802	6.6608	-12
9M	273	-1171	6.6239	-11
1Y	367	-1472	6.5938	-12
18M	549	-1770	6.5640	-40
2Y	732	-1810	6.5600	-50
3Y	1096	-1880	6.5530	-130
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7492	
CLOSING SPOT RATE			6.7410	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-137	-277.2	-677.2	-1046.2	-1347.2
2M		-140.2	-540.2	-909.2	-1210.2
3M			-400	-769	-1070
6M				-369	-670
9M					-301



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