

收盘日评
银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2023-02-20】

今日 Fixing 定在 6.8643，较上一交易日下调了 16 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， T/N 成交在-4.68~-4.63， S/N 成交在-4.63~-4.62。1w 成交在-31.11， -31.1， -31.05， -31， -30.5， -30.4， -30.3， -30.2 的位置；

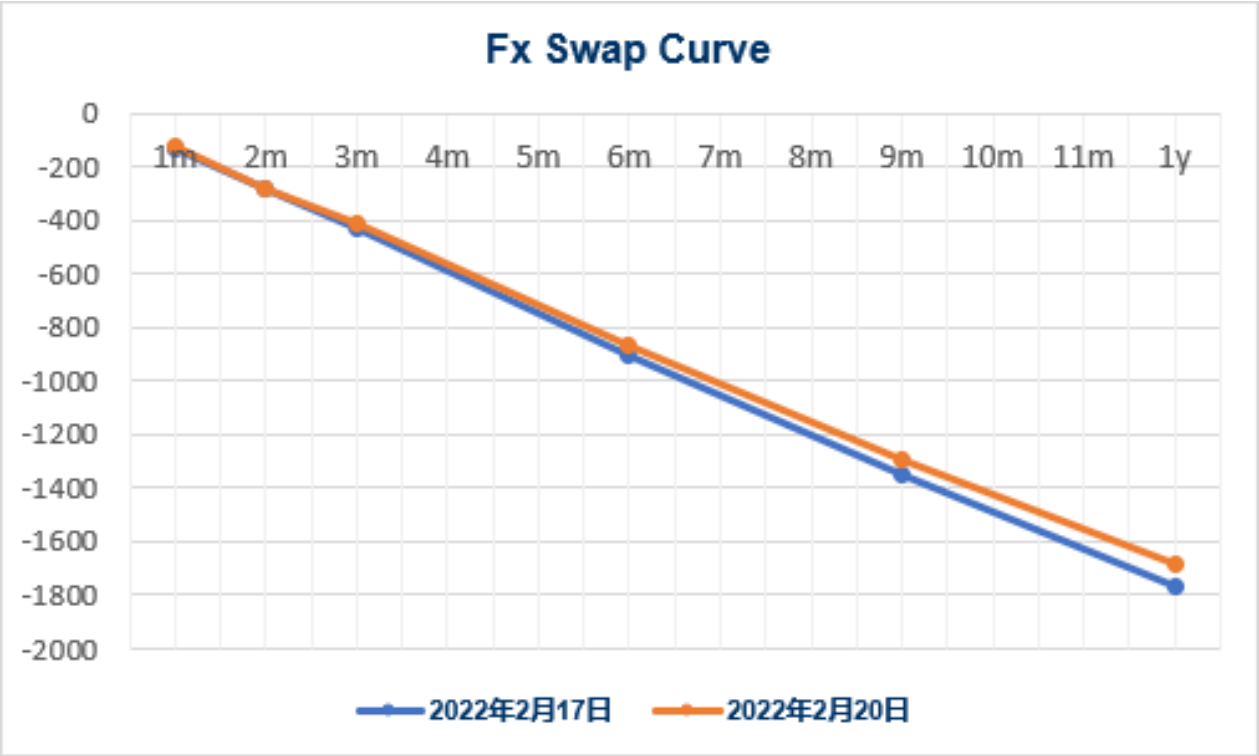
1s 成交在-126， -125.5， -124 的位置； 2s 反复成交在-280， -276 的位置， 3s 成交在-420， -415， -414.5 的位置；

中长期限， 6s 成交在-865， -862 的位置； 9s 成交在-1325， -1323， -1300， -1298， -1292 的位置； 1y 成交在-1720， -1683 的位置； 2y 成交在-2350 的位置；

Spread 上， 1w*1s 成交在-94 的位置， 1s*2s 成交在-152 的位置， 2s*3s 成交在-139 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-30	6.8525	2.35
2W	14	-61	6.8494	3
1M	28	-124	6.8431	5
2M	61	-277	6.8278	1
3M	89	-413	6.8142	21.5
6M	181	-864	6.7691	40
9M	273	-1293	6.7262	60
1Y	365	-1685	6.6870	84
18M	547	-2150	6.6405	150
2Y	733	-2350	6.6205	150
3Y	1097	-2442	6.6113	108
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8643	
CLOSING SPOT RATE			6.8555	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-153	-289	-740	-1169	-1561
2M		-136	-587	-1016	-1408
3M			-451	-880	-1272
6M				-429	-821
9M					-392



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