



【2023-02-16】

今日 Fixing 定在 6.8519，较上一交易日上升了 336 个 bp。各期限收盘价较上一交易日略微有所上升。

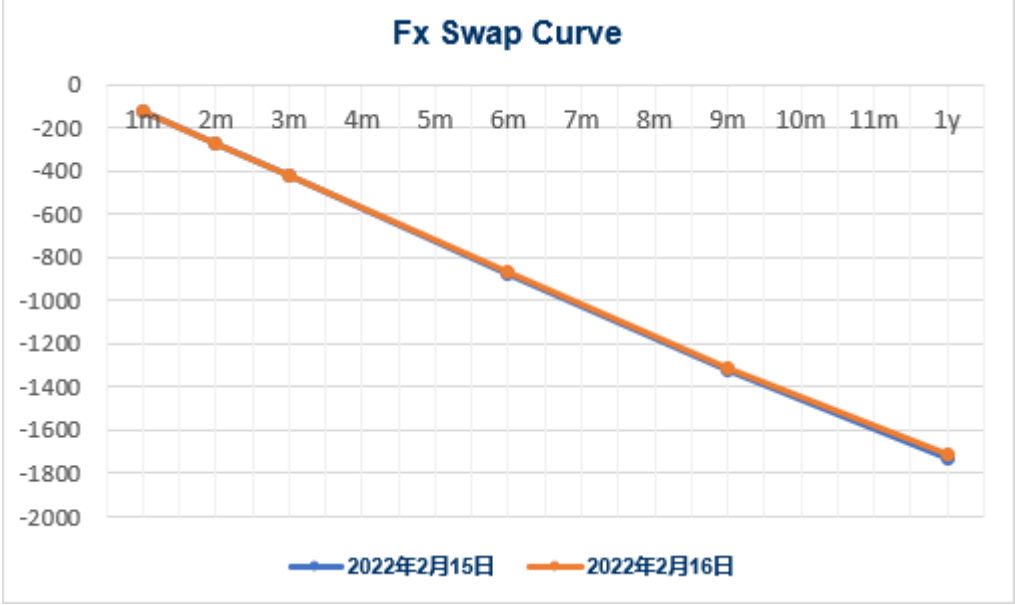
短端，O/N 主要成交在-5~-4。T/N 主要成交在-18.5~-16.5 的位置。S/N 主要成交在-4.7~-4.5 的位置。1w 成交在-32，-31.9，-31.8，-31.75，-31.7，-31.8 等位置。2w 成交在-62，-61.7，-61.5，-61.3 等位置。1s 成交在-126，-126.5，-127，-126.7 的位置。2s 成交在-270，-268，-271 等位置。3s 成交在-416，-416.5，-417，-417.5，-418，-419，-420 等位置。

中长期，6s 成交在-870，-868，-865，-863，-860，-866，-868 等位置。9s 成交在-1300，-1295，-1302 等位置。1y 成交在-1700，-1699，-1697，-1695，-1693，-1698，-1702，-1705，-1710，-1719，-1715，-1710 等位置。

Spread 方面，1w*2w 成交在-29.5 的位置。2s*3s 成交在-149 的位置。9s*12s 成交在-400 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-32	6.8484	-0.1
2W	14	-61	6.8455	1
1M	28	-127	6.8389	0.3
2M	59	-271	6.8245	1
3M	90	-421	6.8095	-2.8
6M	181	-868	6.7648	4
9M	273	1310	6.9826	2631
1Y	365	-1710	6.6806	23
18M	547	-2200	6.6316	20
2Y	731	-2390	6.6126	10
3Y	1098	-2480	6.6036	20
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8519	
CLOSING SPOT RATE			6.8516	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-144.3	-294.3	-741.3	1436.7	-1583.3
2M		-150	-597	1581	-1439
3M			-447	1731	-1289
6M				2178	-842
9M					-3020



文 / Yiff Wang

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