

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2023-02-27】

今日 Fixing 定在 6.9572, 较上一交易日上调了 630 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-5.5~-5.3, T/N 成交在-5.21~-4.6, S/N 成交在-5.09~-4.7。1w 反复成交在-34.7, -34.2, -34.1 的位置; 3w 成交在-102,-101.1,-101 的位置;

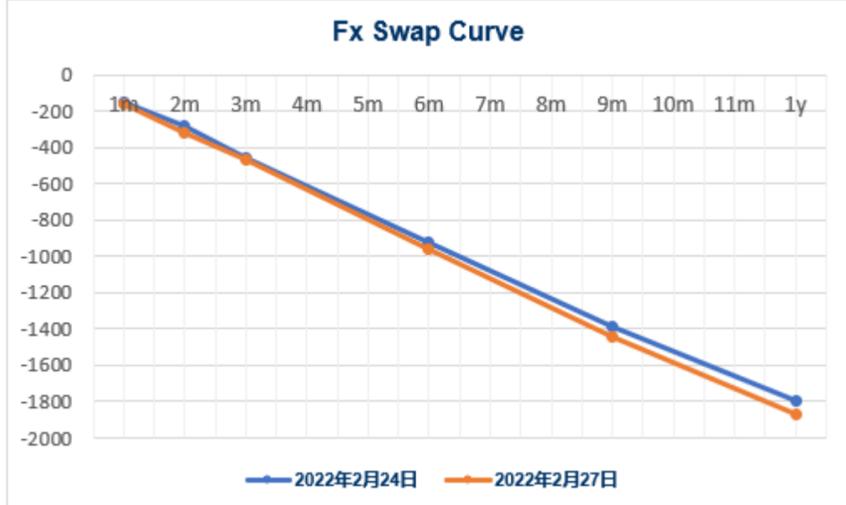
1s 成交在-160, -159, -157 的位置; 3s 成交在-471, -470.5, -470, -469 的位置;

中长期, 6s 成交在-972 的位置; 9s 成交在-1455, -1450, -1447, -1444 的位置; 1y 成交在-1886, -1880, -1876, -1875, -1872, -1860 的位置;

Spread 上, 1w*2w 成交在-34 的位置, 3w*1s 成交在-57.7,-57 的位置, 9s*1y 成交在-426 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-35	6.9611	-1.8
2W	14	-69	6.9576	-4
1M	33	-158	6.9488	-10.5
2M	64	-315	6.9330	-30
3M	92	-465	6.9180	-9
6M	184	-965	6.8680	-38
9M	275	-1447	6.8198	-59
1Y	366	-1873	6.7772	-78
18M	552	-2500	6.7145	-195
2Y	733	-2800	6.6845	-260
3Y	1097	-2988	6.6657	-258
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9572	
CLOSING SPOT RATE			6.9645	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-157.5	-307.5	-807.5	-1289.5	-1715.5
2M		-150	-650	-1132	-1558
3M			-500	-982	-1408
6M				-482	-908
9M					-426



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