

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2023-03-02】

今日 Fixing 定在 6.8808, 较上一交易日下降了 592 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端, O/N 主要成交在-5.5~-5.1。T/N 主要成交在-17.8~-15.3 的位置。S/N 主要成交在-5.4~-5.1 的位置。1w 成交在-35, -34.9, -34.8, -34.95, -35.05, -35.1, -35.11, -35.15, -35.2, -35.5 等位置。2w 成交在-70, -69.5 等位置。3w 成交在-102 的位置。1s 成交在-148, -148.5, -149, -149.3, -149.5 的位置。2s 成交在-310, -311, -311.5, -312, -313 等位置。3s 成交在-470, -468, -472, -467, -469 等位置。

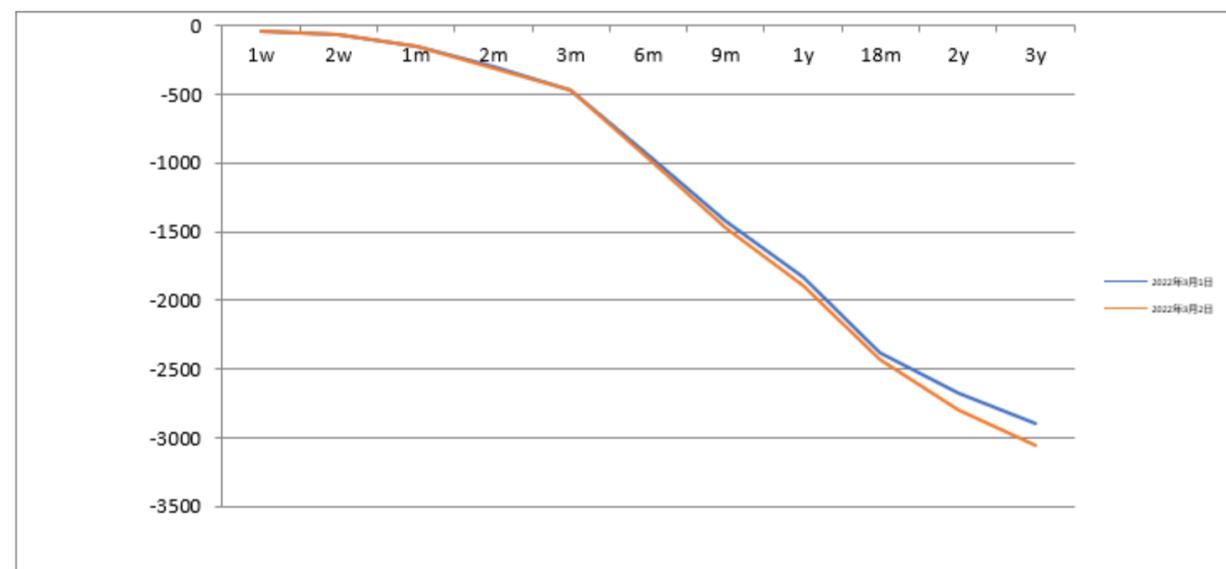
中长期, 6s 成交在-968, -970, -975, -980, -983, -981, -980, -982, -979, -977 等位置。9s 成交在-1460, -1455, -1462, -1464, -1467, -1475, -1478, -1468, -1467 等位置。1y 成交在-1877, -181880, -1885, -1888, -1890, -1893, -1895, -1898, -1900, -1903, -1905, -1910, -1905, -1900, -1896, -1888 等位置。

超长方面, 18s 成交在-2490, -2480 的位置。2y 成交在-2780, -2750 的位置。

Spread 方面, 1w*2w 成交在-34 的位置。2s*3s 成交在-159 的位置。3s*6s 成交在-511, -510 的位置。6s*9s 成交在-483 的位置。9s*12s 成交在-427 的位置。6s*12s 成交在-925 的位置。12s*18s 成交在-585 的位置。18s*2y 成交在-320, -300 的位置。1y*2y 成交在-880, -870 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-36	6.9051	-0.55
2W	14	-70	6.9016	-2
1M	32	-150	6.8937	-3.5
2M	63	-313	6.8773	-17
3M	92	-468	6.8618	-4
6M	187	-975	6.8111	-25
9M	277	-1473	6.7613	-53
1Y	368	-1896	6.7190	-61
18M	551	-2430	6.6656	-50
2Y	732	-2800	6.6286	-120
3Y	1096	-3050	6.6036	-150
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8808	
CLOSING SPOT RATE			6.9086	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-163.5	-318.5	-825.5	-1323.5	-1746.5
2M		-155	-662	-1160	-1583
3M			-507	-1005	-1428
6M				-498	-921
9M					-423



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