

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2023-04-20】

今日 Fixing 定在 6.8987，较上一交易日上升了 256 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端，O/N 主要成交在-5.1~-4.7。T/N 主要成交在-16~-14.2 的位置。S/N 主要成交在-5.3~-5 的位置。1w 成交在-58，-57.7，-57，-56.5，-56.3 等位置。2w 成交在-81.7，-81.5，-81，-80.5 等位置。1s 成交在-180，-179，-177，-176 的位置。2s 成交在-380，-379，-378 等位置。3s 成交在-552，-551，-550，-549，-547，-546，-545 等位置。4s 成交在-724。5s 成交在-910，-905，-900 等位置。

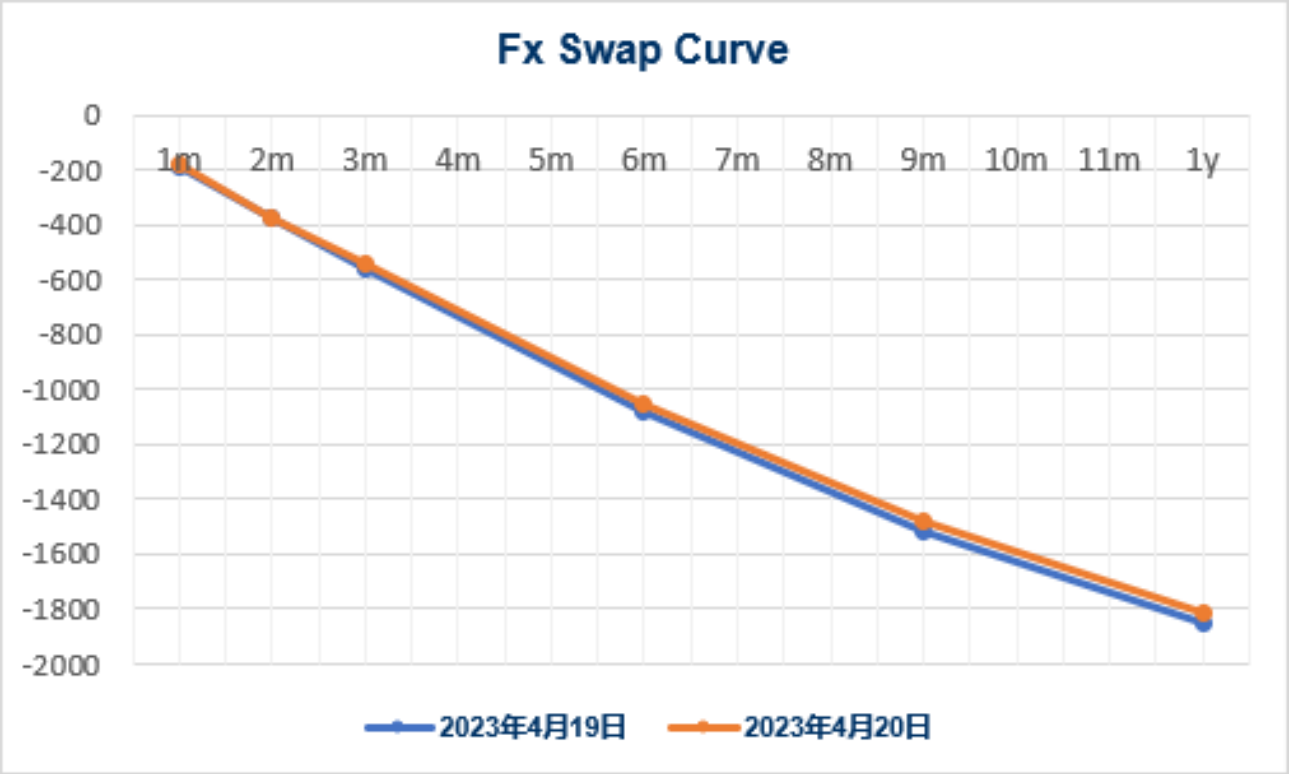
中长期，6s 成交在-1071，-1068，-1065，-1060，-1057，-1055，-1052，-1050 等位置。9s 成交在-1510，-1500，-1492 等位置。1y 成交在-1868，-1862，-1855，-1850，-1849，-1840，-1835，-1830，-1815，-1820 等位置。

超长方面，2y 成交在-2400 的位置。

Spread 方面，1w*2w 成交在-24 的位置。1s*2s 成交在-202 的位置。2s*3s 成交在-172，-168 的位置。2*4s 成交在-346 的位置。5*6s 成交在-152，-151 的位置。3*6s 成交在-508，-506，-505，-504 的位置。6s*12s 成交在-792，-780，-775 的位置。1y*2y 成交在-575，-550 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	10	-56	6.8740	-15.41
2W	14	-81	6.8715	0
1M	30	-176	6.8621	11.1
2M	63	-378	6.8418	-3
3M	91	-545	6.8252	11.5
6M	183	-1049	6.7747	31
9M	275	-1485	6.7311	30
1Y	366	-1813	6.6983	42
18M	549	-2250	6.6546	20
2Y	731	-2450	6.6346	0
3Y	1096	-2600	6.6196	90
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8987	
CLOSING SPOT RATE			6.8796	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-202.5	-369	-873.5	-1309.5	-1637.5
2M		-166.5	-671	-1107	-1435
3M			-504.5	-940.5	-1268.5
6M				-436	-764
9M					-328



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