

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

【2023-02-02】

今日 Fixing 定在 6.7130, 较上一交易日下降了 362 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所上升, 短端有所下降。

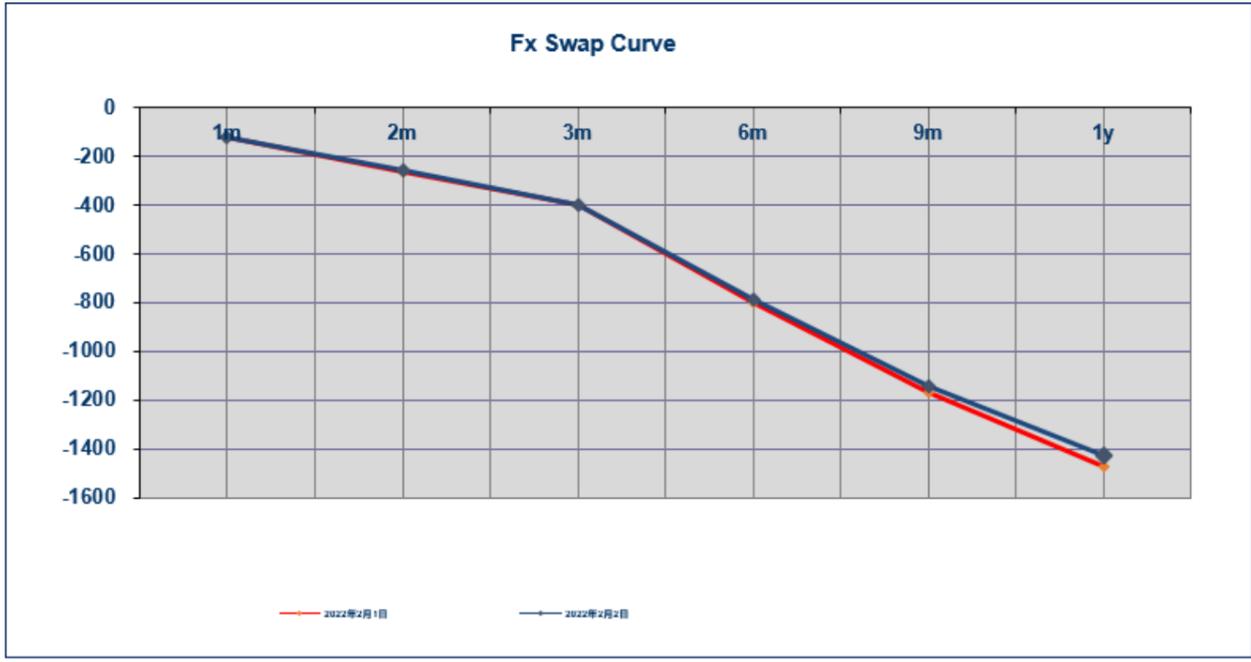
短端, 0/N 主要成交在-4.7~-3.8。T/N 主要成交在-13.5~-11.9 的位置。S/N 主要成交在-4.29~-4.17 的位置。1w 成交在-30, -29.8, -29.9, -30, -30.05, -30.2 等位置。2w 成交在-66, -65, -65.05, -65.2 等位置。1s 成交在-123.5, -123.8, -124, -124.2 的位置。2s 成交在-260, -261, -259.5, -259 等位置。3s 成交在-395, -398, -400, -397, -399, -401, -402 等位置。5s 成交在-645 的位置。

中长期, 6s 成交在-770, -775, -778, -780, -783, -785, -787, -788, -789 等位置。9s 成交在-1125, -1123, -1130, -1135, -1140 等位置。1y 成交在-1400, -1410, -1405, -1400, -1410, -1415, -1420, -1425, -1428, -1430 等位置。

Spread 方面, 1w*2w 成交在-35 的位置。2w*1s 成交在-59 的位置。1*2s 成交在-135 的位置。3*6s 成交在-386 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-30	6.7191	-1.19
2W	15	-66	6.7156	-6
1M	28	-124	6.7097	1
2M	59	-260	6.6962	2
3M	91	-402	6.6820	0.5
6M	182	-790	6.6431	12
9M	273	-1141	6.6080	30
1Y	365	-1430	6.5791	42
18M	547	-1700	6.5521	70
2Y	731	-1750	6.5471	60
3Y	1096	-1700	6.5521	180
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7130	
CLOSING SPOT RATE			6.7221	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-135.7	-277.7	-666.2	-1017.2	-1306.2
2M		-142	-530.5	-881.5	-1170.5
3M			-388.5	-739.5	-1028.5
6M				-351	-640
9M					-289



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