

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2023-03-29】

今日美元/人民币中间价报 6.8771，较上一个交易日上调 22bp，各期限收盘价较上一交易日基本持平。

ON 成交在-7.5~-7.3 之间；TN 成交在-7.9~-7.07 之间，尾盘收在-7.6~-7.59 附近；SN 成交在-21~-20.9 之间。1W 成交在-48.5~-48.05 之间，尾盘收在-48.05；2W 成交在-93.5~-93 之间。1S 成交在-185~-179 之间；2S 成交在-382~-374 之间；3S 成交在-556~-550 之间，尾盘收在-550 附近。

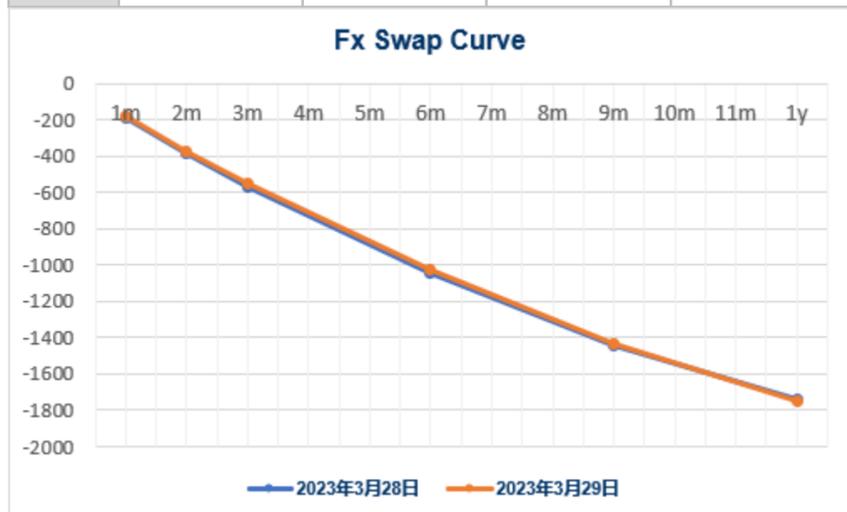
中长期限，6S 从-1035 买到-1022；9S 成交在-1467~-1435 附近，尾盘收在-1435；1Y 成交在-1750~-1728 之间。

超长期限，2Y 成交在-2150、-2200、-2190。

Spread 方面，1W\*2W 成交在-45，1\*2S 成交在-178，1\*3S 成交在-373，2\*3S 成交在-177，6\*9S 成交在-404，9\*12 成交在-305。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	6.8835	-0.65
2W	14	-93	6.8790	1
1M	28	-178	6.8705	7.4
2M	61	-373	6.8510	10
3M	91	-553	6.8331	12.5
6M	181	-1029	6.7855	14
9M	273	-1435	6.7448	7
1Y	364	-1747	6.7136	-2
18M	549	-2100	6.6783	0
2Y	731	-2180	6.6703	42
3Y	1096	-2300	6.6583	-55
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8771	
CLOSING SPOT RATE			6.8883	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-194.9	-374.4	-850.4	-1256.9	-1568.9
2M		-179.5	-655.5	-1062	-1374
3M			-476	-882.5	-1194.5
6M				-406.5	-718.5
9M					-312



文 /Cathy He

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