

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

【2023-03-20】

今日 Fixing 定在 6.8694, 较上一交易日下调了 358 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端, O/N 成交在-4.8~-4.5, T/N 成交在-5.83~-5.53, S/N 成交在-5.75~-5.69。1w 反复成交在-40.8, -39.6, -39.5 的位置;

1s 成交在-185, -184.5, -184 的位置; 2s 成交在-342 的位置; 3s 成交在-540, -538, -535, -530 的位置;

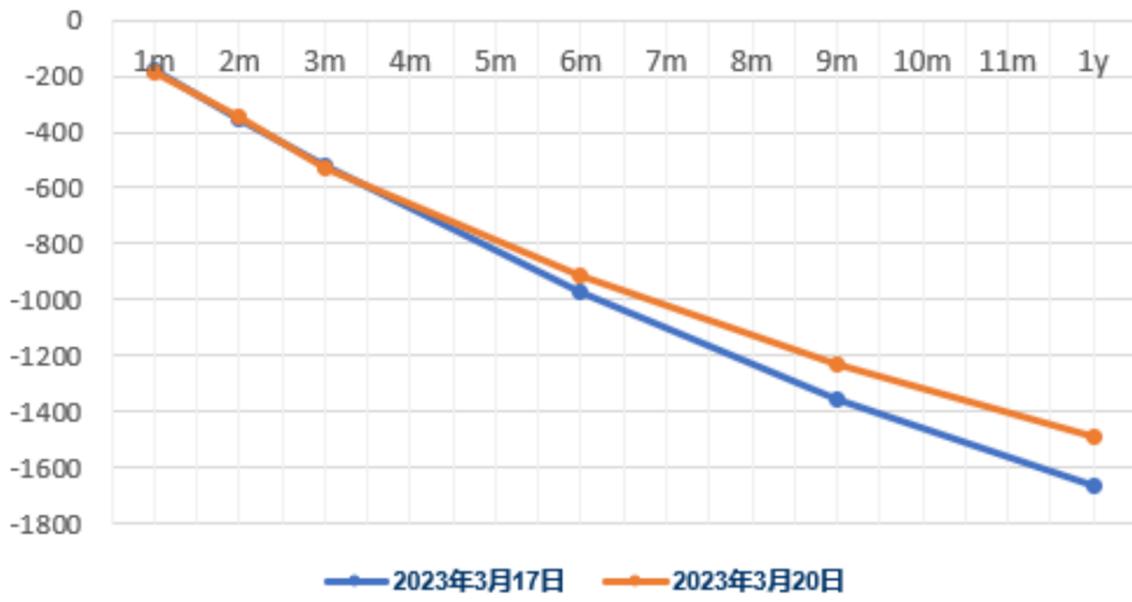
中长期, 6s 成交在-960, -920, -918 的位置; 9s 成交在-1310, -1291, -1280, -1243 的位置; 1y 反复成交在-1620, -1600, -1575, -1560, -1535, -1520, -1500 的位置; 2y 成交在-1970, -1950 的位置; 3y 成交在-2250, -2225, -2200, -2150 的位置;

Spread 上, 1s*2s 成交在-157 的位置, 2s*3s 成交在-193 的位置, 6s*1y 成交在-660 的位置, 1y*2y 成交在-430 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	6.8890	-2.55
2W	15	-87	6.8844	-10
1M	33	-187	6.8745	-11.5
2M	61	-344	6.8588	9
3M	96	-530	6.8401	-12.2
6M	184	-916	6.8015	58
9M	275	-1236	6.7695	119
1Y	366	-1492	6.7439	175
18M	551	-1800	6.7131	270
2Y	733	-1830	6.7101	470
3Y	1097	-2200	6.6731	400
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8694	
CLOSING SPOT RATE			6.8931	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-157	-343.5	-729.5	-1049.5	-1305.5
2M		-186.5	-572.5	-892.5	-1148.5
3M			-386	-706	-962
6M				-320	-576
9M					-256

Fx Swap Curve



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:

以上所提及的所有信息（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