

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2023-03-15】

今日美元/人民币中间价报 6.8680，较上一个交易日下调 269bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 成交在-5.5~5 之间；TN 在-6.14~-5.83 之间来回成交，尾盘收在-5.85~-5.83 附近；SN 在-18.3~-18 之间来回成交。1W 成交在-43~-42.95 之间；2W 成交在-85 附近；3W 成交在-129~-126 之间。1S 成交在-187~-184 之间；2S 成交在-360~-355 之间；3S 成交在-552~-545 之间。

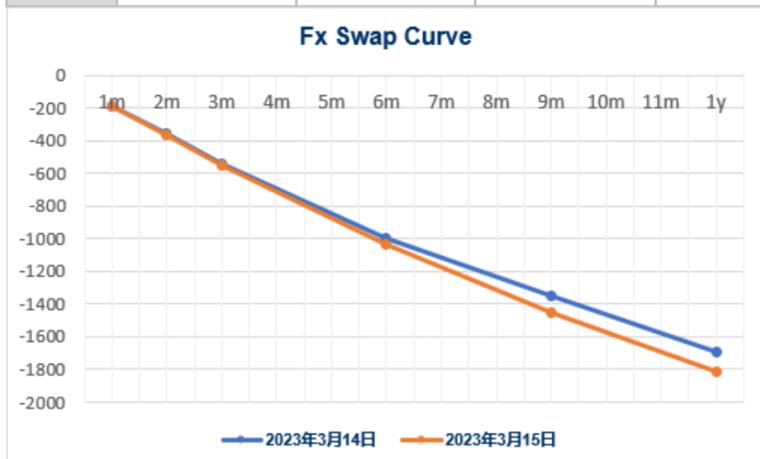
中长期，6S 成交在-1014~-1005 之间；9S 成交在-1388 附近；1Y 成交在-1780~-1730 之间，尾盘收在-1800 附近。

超长期，2Y 成交在-2380、-2420。

Spread 方面，1\*2S 成交在-170，1\*2Y 成交在-690。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	6.8947	0.05
2W	14	-85	6.8905	-2
1M	31	-187	6.8803	5
2M	61	-361	6.8629	-3
3M	95	-555	6.8435	-16
6M	185	-1035	6.7955	-36
9M	276	-1450	6.7540	-98
1Y	367	-1811	6.7179	-121
18M	551	-2235	6.6755	-85
2Y	731	-2485	6.6505	-235
3Y	1096	-2750	6.6240	-150
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8680	
CLOSING SPOT RATE			6.8990	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-174	-368	-848	-1263	-1624
2M		-194	-674	-1089	-1450
3M			-480	-895	-1256
6M				-415	-776
9M					-361



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: 以上所登及附加的所有信息 (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, 所有陈述和保证均按免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN