

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2023-03-27】

今日 Fixing 定在 6.8714, 较上一交易日上调了 340 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所下降。

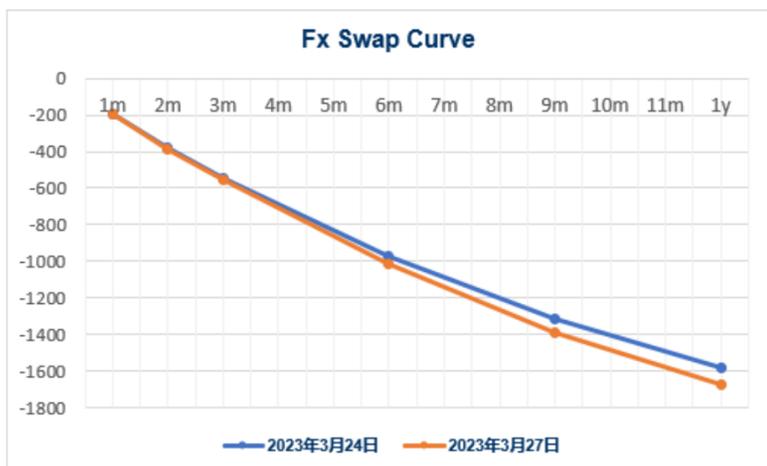
短端, O/N 成交在-6.95~-6.93, T/N 成交在-7.05~-6.85, S/N 成交在-6.95~-6.9。1w 反复成交在-54.5, -53.5 的位置;
1s 成交在-192, -191, -189.8, -189 的位置; 2s 成交在-383 的位置; 3s 成交在-556, -555 的位置;

中长期, 6s 成交在-1017, -1011, -1006 的位置; 9s 成交在-1342, -1335 的位置; 1y 反复成交在-1677, -1675, -1670, -1655, -1622, -1620, -1618 的位置;

Spread 上, 2w*1s 成交在-97.5 的位置, 1s*2s 成交在-193 的位置, 3s*6s 成交在-457 的位置, 6s*1y 成交在-660 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-55	6.8765	-8.4
2W	14	-94	6.8727	-4
1M	30	-192	6.8628	-1
2M	62	-386	6.8434	-5
3M	92	-557	6.8263	-14.5
6M	183	-1013	6.7807	-38
9M	275	-1388	6.7432	-72
1Y	366	-1678	6.7142	-98
18M	551	-1940	6.6880	-90
2Y	733	-2050	6.6770	-150
3Y	1097	-2121	6.6699	-121
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8714	
CLOSING SPOT RATE			6.8820	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-194	-365	-821	-1196	-1486
2M		-171	-627	-1002	-1292
3M			-456	-831	-1121
6M				-375	-665
9M					-290



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:

以上所寄及附加的所有信息 (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