

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2023-03-06】

今日 Fixing 定在 6.8951, 较上一交易日下调了 166 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-6.5~-6.28, T/N 成交在-6.9~-5.9, S/N 成交在-6.4~-6.1。1w 反复成交在-40.8, -40.5, -40.4, -40.35, -40.25, -40.15, -40.1 的位置; 2w 反复成交在-77, -76 的位置; 3w 成交在-112, -111.5, -109.5 的位置;

1s 成交在-166.8, -166.5, -165.5, -165 的位置; 3s 成交在-473, -472 的位置;

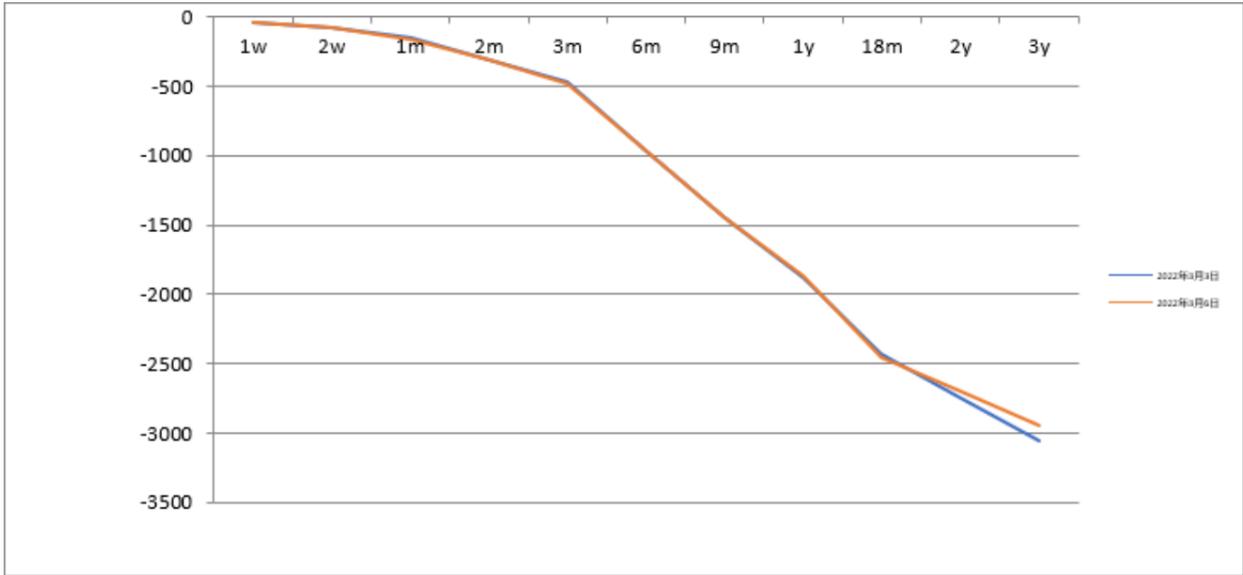
中长期, 6s 成交在-970, -969, -968 的位置; 9s 成交在-1448, -1446, -1444 的位置; 1y 反复成交在-1865, -1864, -1861, -1860 的位置; 2y 成交在-2705 的位置;

Spread 上, 1w*2w 成交在-36, -35.72 的位置, 3w*1s 成交在-54 的位置, 2s*3s 成交在-162.5,-162 的位置, 3s*6s 成交在-495 的位置, 6s*9s 成交在-477 的位置, 1y*2y 反复成交在-840 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	6.9153	-2.45
2W	14	-77	6.9118	-3
1M	33	-168	6.9026	-13.4
2M	61	-314	6.8880	0
3M	92	-477	6.8717	-5
6M	184	-972	6.8222	-2
9M	275	-1449	6.7745	6
1Y	366	-1862	6.7332	13
18M	551	-2450	6.6744	-20
2Y	733	-2700	6.6494	50
3Y	1097	-2950	6.6244	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8951	
CLOSING SPOT RATE			6.9194	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-146.1	-309.1	-804.1	-1281.1	-1694.1
2M		-163	-658	-1135	-1548

3M			-495	-972	-1385
6M				-477	-890
9M					-413



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