

收盘日评 银行间外汇远掉市场

【2023-01-31】

今日美元/人民币中间价报 6.7604，较上一个交易日下调 22bp，全天掉期市场交投活跃。

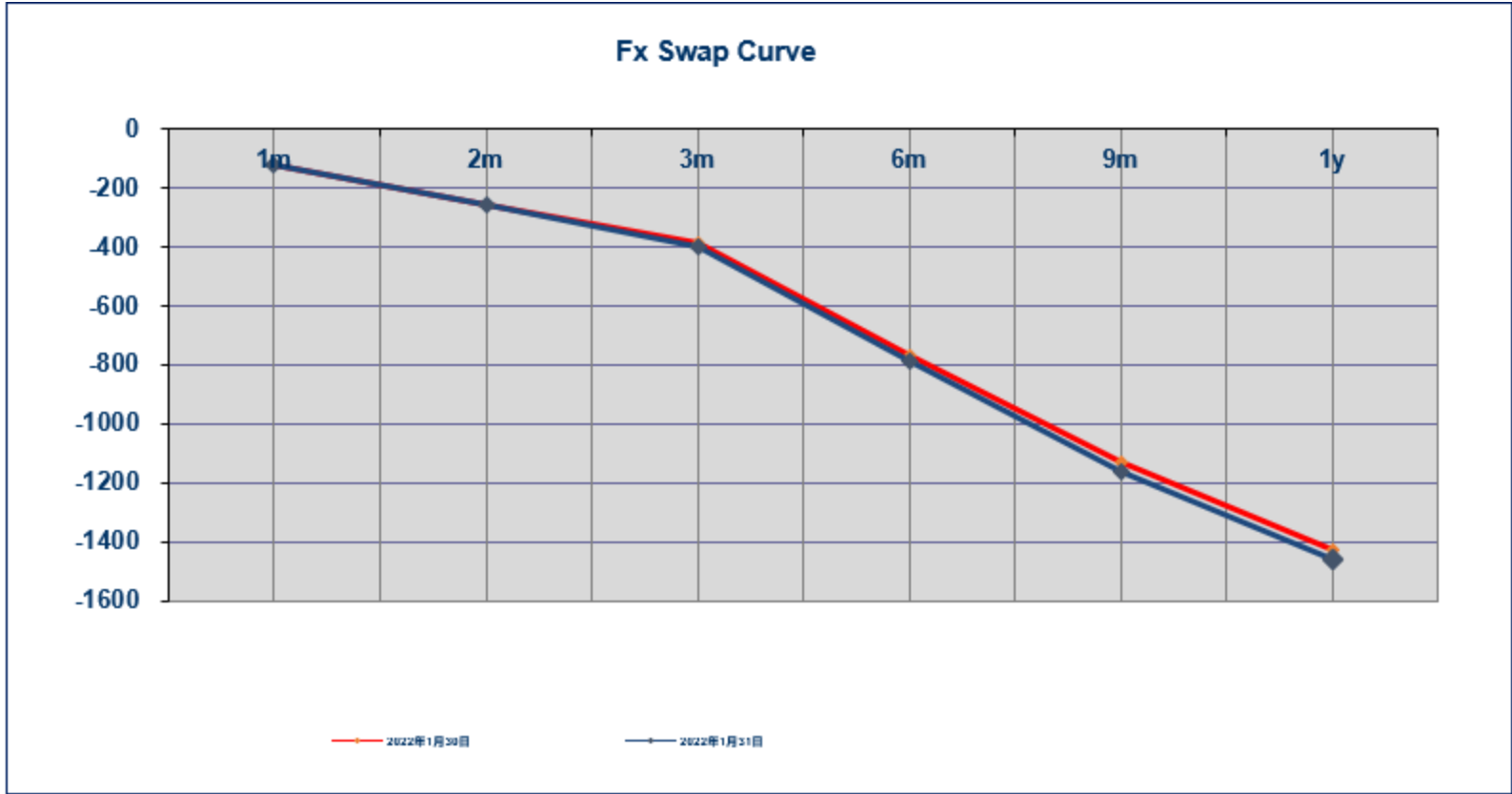
O/N 成交在-3.2， -3.3， -3.45； T/N 成交在-4.2~-3.6， 反复成交在-4.2， -4； S/N 成交在-4.04~-3.84； 1w 成交在-28， -28.4； 1s 反复成交在-121， -120， -120.8； 2s 成交在-260。 3s 成交在-394.5~-405， 后面尾盘给到-405。

中长期限， 9s 成交在-1155； 1y 成交在-1460~-1450， 反复成交在-1455， -1450。

Spread 方面， 1s*2s 成交在-139， -139.5； -140， -141； 2s*3s 成交在-137~-134； 3s*9s 成交在-760~-758； 3s*1y 成交在-1061； 18s*2y 成交在-75。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-29	6.7543	0.5
2W	14	-60	6.7511	-1
1M	28	-121	6.7450	1
2M	60	-261	6.7310	-1
3M	91	-403	6.7169	-13.5
6M	181	-790	6.6781	-23
9M	273	-1160	6.6411	-30
1Y	365	-1460	6.6111	-35
18M	547	-1730	6.5841	-30
2Y	733	-1760	6.5811	-85
3Y	1096	-1750	6.5821	-130
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7604	
CLOSING SPOT RATE			6.7571	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-140	-281.5	-669	-1039	-1339
2M		-141.5	-529	-899	-1199
3M			-387.5	-757.5	-1057.5
6M				-370	-670
9M					-300



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