

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

【2023-03-23】

今日 Fixing 定在 6.8709, 较上一交易日下降了 6 个 bp。各期限收盘价较上一交易日略微有所上升, 短端有所下降, 今日交投较活跃。

短端, O/N 主要成交在-6.5~-6。T/N 主要成交在-19.8~-18.5 的位置。S/N 主要成交在-6.6~-6.1 的位置。1w 成交在-43, -43.2, -43.1, -43, -42.7, -43.2, -43.5, -43.7, -44 等位置。2w 成交在-86, -85.5, -85.7, -86.1 等位置。3w 成交在-127 的位置。1s 成交在-187, -186 的位置。2s 成交在-377, -378, -379 等位置。3s 成交在-538, -537, -535, -540 等位置。

中长期, 6s 成交在-970, -980, -985, -987, -983, -986, -990 等位置。9s 成交在-1330, -1325, -1327, -1330, -1333, -1340, -1344 等位置。1y 成交在-1625, -1630, -1645, -1649, -1635, -1625, -1610, -1614, -1620, -1629, -1635, -1628, -1640 等位置。

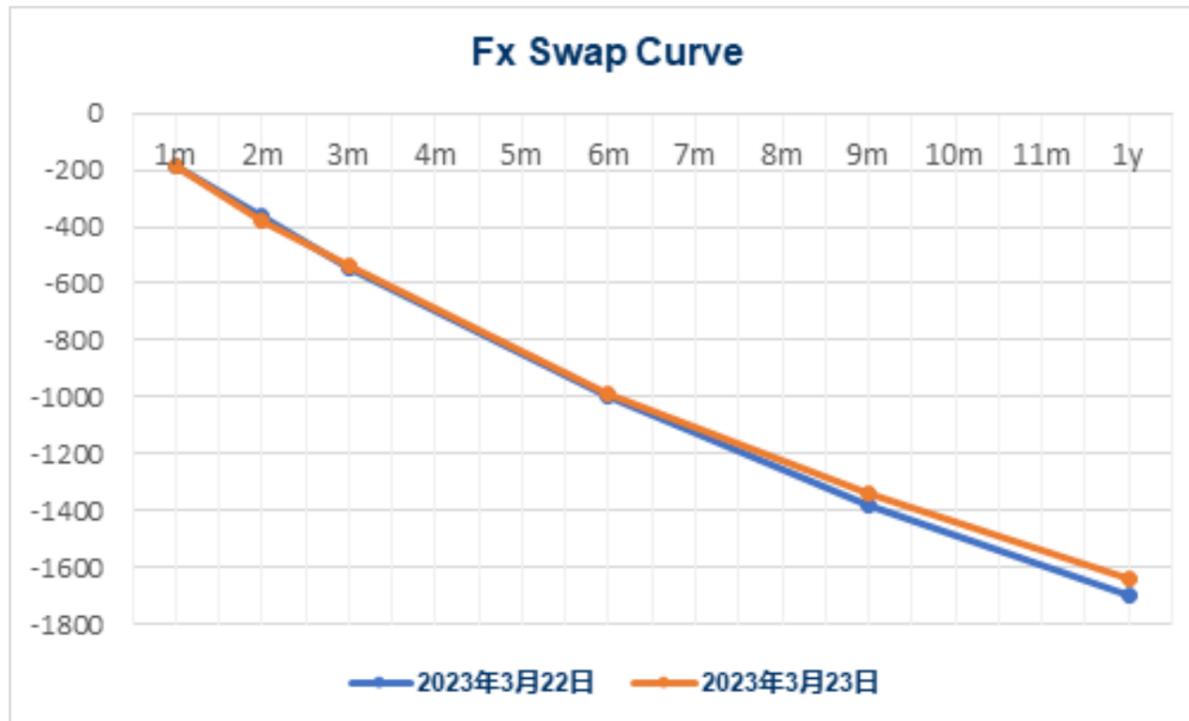
超长方面, 2y 成交在-2080 的位置, 3y 成交在-2220, -2200 的位置。

Spread 方面, 1w*2w 成交在-42.5 的位置。3s*6s 成交在-450 的位置。6s*9s 成交在-340 的位置。6s*12s 成交在-645 的位置。9s*12s 成交在-302, -300, -295, -290, -294, 293, -292 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	6.8246	-1.4
2W	14	-86	6.8203	-3
1M	31	-187	6.8102	-1.5
2M	64	-380	6.7909	-22
3M	92	-537	6.7752	9
6M	184	-988	6.7301	12
9M	275	-1343	6.6947	37.5
1Y	366	-1640	6.6649	60
18M	550	-1950	6.6339	100
2Y	731	-2065	6.6224	185
3Y	1096	-2250	6.6039	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8709	
CLOSING SPOT RATE			6.8289	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-193	-350	-801	-1155.5	-1453
2M		-157	-608	-962.5	-1260

3M			-451	-805.5	-1103
6M				-354.5	-652
9M					-297.5



文 / Yiff Wang

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