

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

【2023-03-13】

今日 Fixing 定在 6.9375，较上一交易日下调了 280 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-5.8~-5.5，T/N 成交在-6.1~-5.6，S/N 成交在-5.87~-5.76。1w 反复成交在-40.5，-40.48，-40.4 的位置；2w 反复成交在-79 的位置；

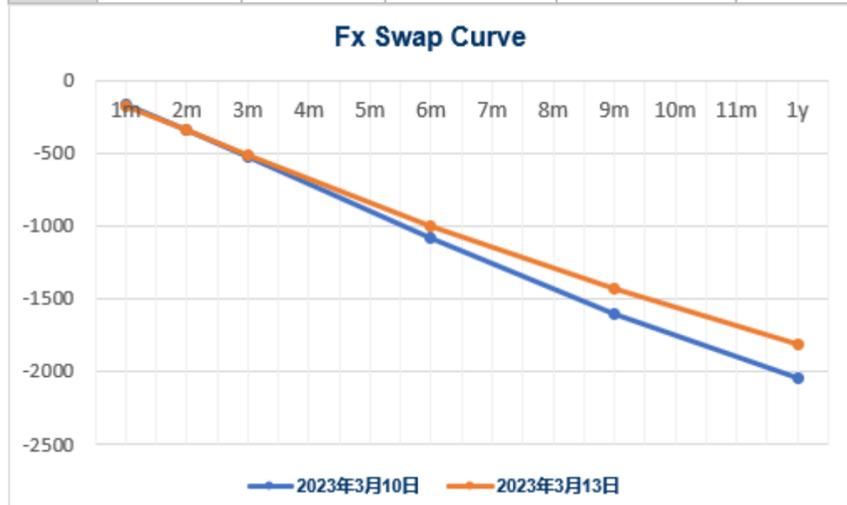
1s 成交在-179.5，-178.5，-178，-177，-174 的位置；2s 成交在-332.5 的位置；3s 成交在-520，-515，-513，-512，-511，-510，-505 的位置；

中长期，6s 成交在-1030，-1020，-1018，-1009，-1007，-980，-975 的位置；9s 成交在-1442，-1440，-1435，-1430，-1425，-1420，-1400 的位置；1y 反复成交在-1869，-1835，-1820，-1810，-1800 的位置；2y 成交在-2500 的位置；

Spread 上，1w*2w 成交在-38.5 的位置，1s*3s 成交在-337 的位置，2s*3s 成交在-183，-182，-179 的位置，3s*1y 成交在-1290 的位置，9s*1y 成交在-378，-375 的位置，1y*2y 成交在-700 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	6.8964	-1.7
2W	14	-79	6.8926	1
1M	33	-180	6.8825	-9.5
2M	61	-335	6.8670	10
3M	92	-516	6.8489	8.5
6M	184	-1003	6.8002	82
9M	275	-1435	6.7570	166
1Y	366	-1810	6.7195	242
18M	551	-2300	6.6705	360
2Y	733	-2525	6.6480	455
3Y	1097	-2750	6.6255	450
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9375	
CLOSING SPOT RATE			6.9005	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-155	-336	-823	-1255	-1630
2M		-181	-668	-1100	-1475
3M			-487	-919	-1294
6M				-432	-807
9M					-375



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