

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

【2023-04-03】

今日 Fixing 定在 6.8805，较上一交易日上调了 88 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上升。

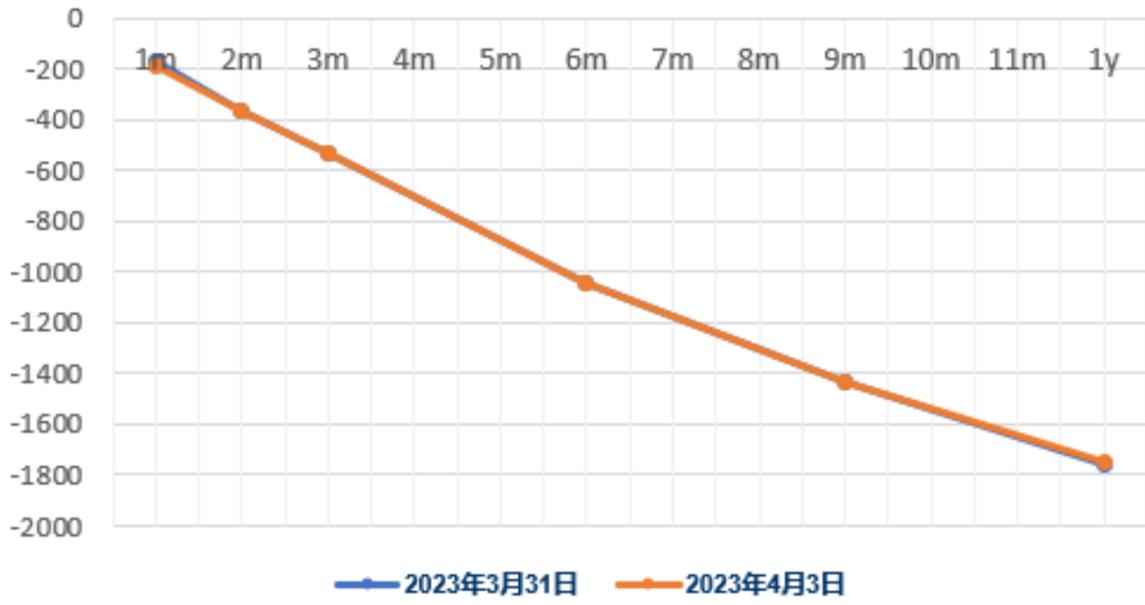
短端，O/N 成交在-6.7~-6.35，T/N 成交在-12.8~-12.1，S/N 成交在-6.45~-6.3。1w 反复成交在-43.5，-43.45，-43.4，-43.3，-43.2，-43.1 的位置；1s 成交在-186 的位置；2s 成交在-360.5 的位置；中长期限，1y 反复成交在-1750，-1748 的位置；2y 成交在-2230 的位置；3y 成交在-2390 的位置；

Spread 上，9s*1y 成交在-315 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	6.8862	-1.45
2W	14	-86	6.8820	-2
1M	32	-186	6.8719	-14
2M	61	-361	6.8544	0
3M	91	-536	6.8369	-1
6M	187	-1040	6.7865	8
9M	277	-1438	6.7467	-8
1Y	3678	-1749	6.7156	6
18M	551	-2120	6.6785	-20
2Y	732	-2230	6.6675	-10
3Y	1096	-2390	6.6515	-90
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8805	
CLOSING SPOT RATE			6.8905	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-175	-350	-854	-1252	-1563
2M		-175	-679	-1077	-1388
3M			-504	-902	-1213
6M				-398	-709
9M					-311

Fx Swap Curve



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:

以上所提及的所有信息（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