



【2023-01-20】

今日美元/人民币中间价报 6.7702，较上一个交易日上调 28bp，各期限收盘价较上一交易日略微下行。

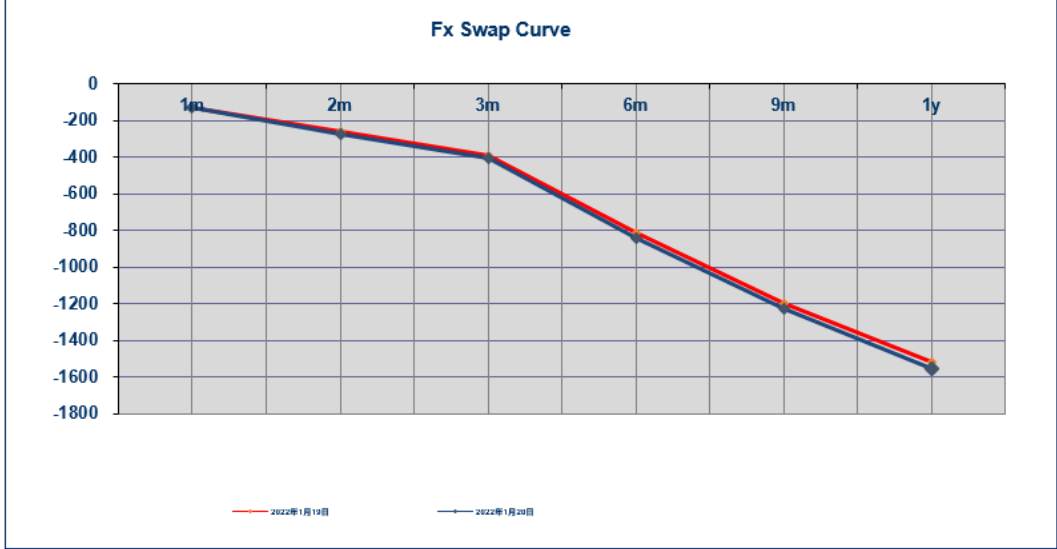
ON 从-45 一路买到-40； TN 成交在-4.9~-4.6 之间，尾盘收在-4.75 附近； SN 成交在-4.52~-4 之间。1W 成交在-31 附近； 1S 成交在-137~-133 附近； 2S 成交在-280~-269 附近； 3S 成交在-411~-405 附近。

中长期限， 6S 成交在-848~-830 区间； 9S 成交在-1230~-1220 区间； 1Y 成交在-1590~-1545 区间。

Spread 方面， 2S*3S 成交在-130。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-31	6.7735	-1
2W	14	-65	6.7701	-5
1M	28	-134	6.7632	-6.5
2M	59	-275	6.7491	-12
3M	87	-405	6.7361	-10
6M	181	-840	6.6926	-25
9M	273	-1230	6.6536	-30
1Y	365	-1555	6.6211	-35
18M	547	-1780	6.5986	-40
2Y	727	-1750	6.6016	-45
3Y	1095	-1670	6.6096	-15
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7702	
CLOSING SPOT RATE (15:30)			6.7766	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-141	-271	-706	-1096	-1421
2M		-130	-565	-955	-1280
3M			-435	-825	-1150
6M				-390	-715
9M					-325



文 / Cathy He

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