



【2023-02-21】

今日美元/人民币中间价报 6.8557，较上一个交易日下调 86bp，全天掉期市场交投活跃。

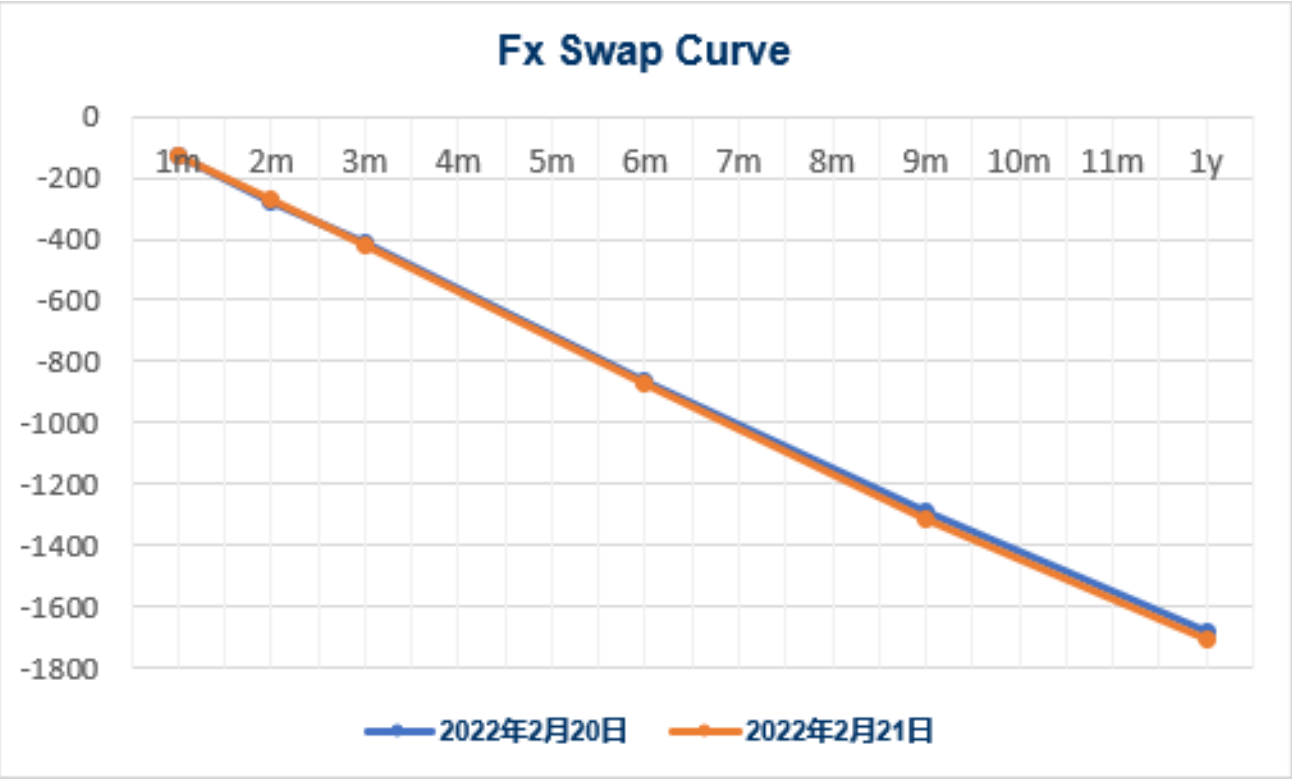
O/N 成交在-4.9~-4.44；T/N 成交在-4.43 给到-4.68；S/N 成交在-4.62~-4.45； 1w 成交在-29.6~-30； 1s 成交在-124.5； 2s 成交在-273， -274； 3s 成交在-417， -419。

中长期限，6s 成交在-875， -874， -872； 1y 从-1680 给到-1710， -1715 附近，尾盘收在-1710。

Spread 方面， 3s*6s 成交在-459； 6s*9s 成交在-445； 6s*1y 成交在-837~-831。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-30	6.8704	0.05
2W	14	-62	6.8672	-1
1M	28	-124	6.8610	-0.4
2M	60	-274	6.8460	3
3M	89	-418	6.8317	-4.5
6M	181	-872	6.7862	-8
9M	274	-1314	6.7420	-21
1Y	365	-1705	6.7029	-20
18M	547	-2200	6.6534	-50
2Y	732	-2400	6.6334	-50
3Y	1096	-2500	6.6234	-58
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8557	
CLOSING SPOT RATE			6.8734	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-149.8	-293.1	-747.6	-1189.6	-1580.6
2M		-143.3	-597.8	-1039.8	-1430.8
3M			-454.5	-896.5	-1287.5
6M				-442	-833
9M					-391



文 / Edison Zeng

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