



【2023-04-12】

今日美元/人民币中间价报 6.8854，较上一个交易日下调 28bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

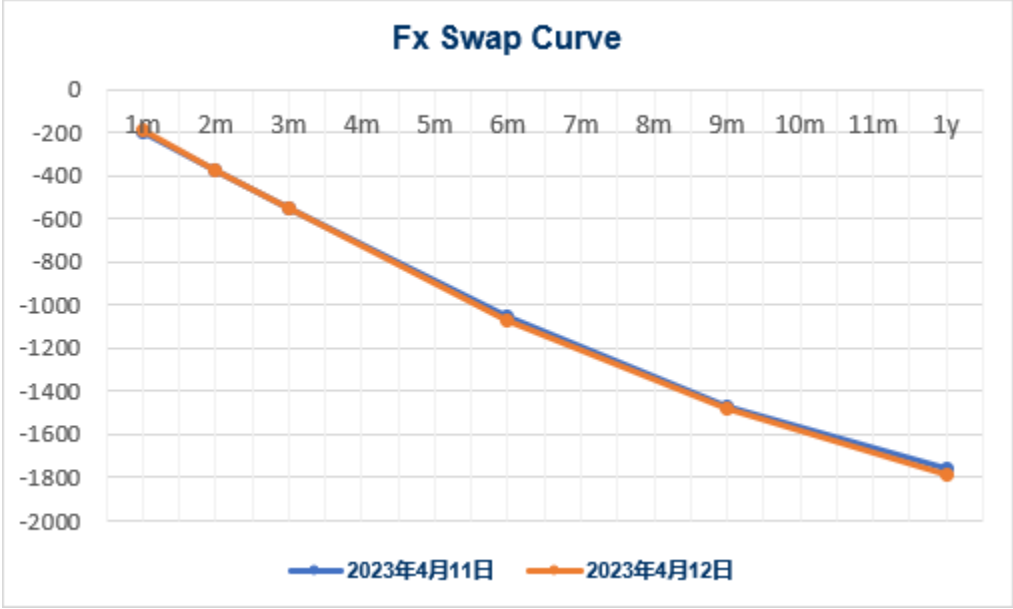
ON 成交在-6.57~-6.5 之间，午后成交在-6.65；TN 从-6.65 买到-6.55，午后买到-6.25，尾盘收在-6.37；SN 成交在-19.7~-19.36 之间。1W 成交在-44.2~-44 之间；2W 成交在-88~-87.8 之间；3W 成交在-129~-128 之间。1S 成交在-188.5 附近；2S 成交在-373 附近；3S 成交在-558~-555 之间；5S 成交在-906~-895 之间。

中长期限，6S 成交在-1074~-1070 之间；9S 成交在-1487~-1482 之间；1Y 从-1790 给到-1795，后买回-1792。

Spread 方面，1W*2W 成交在-42.6，2W*3W 成交在-41.4，3W*1S 成交在-61，2*3S 成交在-183，6*9S 成交在-414，6*12S 成交在-722、-720，9*12 成交在-308、-307。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	6.8788	-0.15
2W	14	-88	6.8744	-2
1M	31	-190	6.8642	4.5
2M	61	-373	6.8459	-1
3M	91	-555	6.8277	-3
6M	185	-1070	6.7762	-20
9M	277	-1484	6.7348	-15
1Y	367	-1791	6.7041	-33
18M	550	-2150	6.6682	-40
2Y	731	-2250	6.6582	-70
3Y	1096	-2300	6.6532	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8854	
CLOSING SPOT RATE			6.8832	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-183	-365	-880	-1294	-1601
2M		-182	-697	-1111	-1418
3M			-515	-929	-1236
6M				-414	-721
9M					-307



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