



【2023-03-21】

今日美元/人民币中间价报 6.8763，较上一个交易日上调 69bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-4.8~4.58，集中成交在-4.8， -4.6； T/N 成交在-5.45~-5.22； S/N 成交在-5.7~-5.3； 1w 成交在-40.1~-39； 2w 成交在-81~-79； 2s 成交在-344； 3s 成交在-526~-521 。

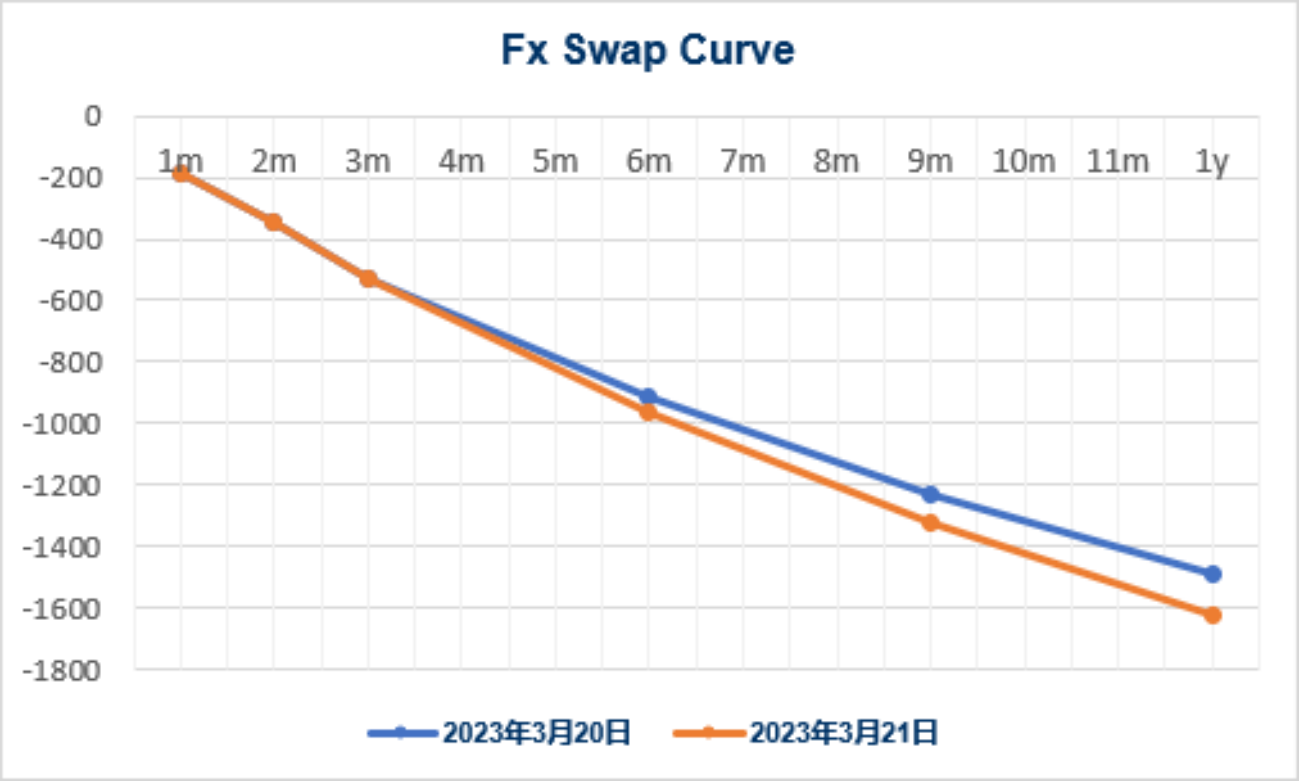
中长期限， 6s 从-950 买到-940，后面又给到-950 附近； 9s 成交在-1302， -1298； 1y 早上从-1560 买到-1550， 下午从-1560 一路给到-1625， 最后收在-1620 附近。

超长期限， 3y 成交在-2250， -2220；

Spread 方面， 3s*6s 成交在-422， -420； 6s*1y 成交在-620。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	6.8698	1.2
2W	14	-81	6.8657	6
1M	32	-183	6.8556	4
2M	61	-347	6.8391	-4
3M	95	-528	6.8210	2
6M	186	-965	6.7773	-49
9M	278	-1325	6.7413	-89
1Y	368	-1621	6.7117	-129
18M	550	-1900	6.6838	-100
2Y	732	-2120	6.6618	-290
3Y	1096	-2200	6.6538	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8763	
CLOSING SPOT RATE			6.8738	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-164.5	-345.5	-782.5	-1142.5	-1438.5
2M		-181	-618	-978	-1274
3M			-437	-797	-1093
6M				-360	-656
9M					-296



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