



【2023-03-08】

今日美元/人民币中间价报 6.9525，较上一个交易日上调 369bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

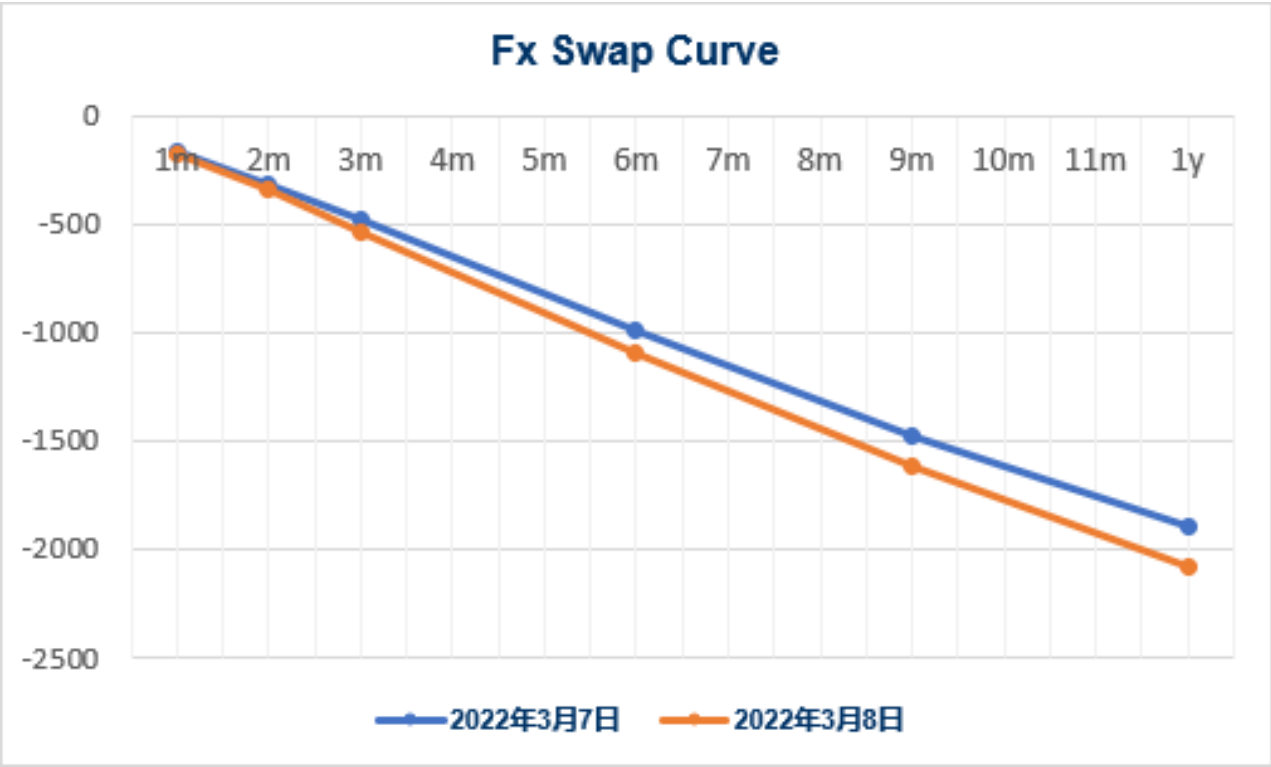
ON 成交在-6~-5.9 之间；TN 从-6.25 给到-6.46，后一路买回-5.7，尾盘收在-5.9 附近；SN 成交在-18.95~-18.8 之间。1W 在-43.37~-40.5 之间来回成交；2W 从-81.4 买到-79；3W 成交在-118.5 附近。1S 成交在-173~-172 之间；2S 成交在-346~-338 附近；3S 成交在-540~-530 附近。

中长期限，6S 成交在-1090~-1084.5 之间；9S 从-1555 一路给到-1620；1Y 从-2030 一路给到-2080，后买回-2075、-2070，尾盘收到-2081 附近。

Spread 方面，1W*2W 成交在-38.2、-38.5，6*9S 成交在-530、-529，9*12S 成交在-460、-458，1*2Y 成交在 950、-980。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-42	6.9664	-0.1
2W	14	-79	6.9627	-1
1M	31	-173	6.9533	-6.7
2M	61	-342	6.9364	-25
3M	94	-540	6.9166	-55
6M	185	-1097	6.8609	-101
9M	276	-1621	6.8085	-145
1Y	367	-2087	6.7619	-192
18M	550	-2750	6.6956	-270
2Y	731	-3060	6.6646	-320
3Y	1096	-3350	6.6356	-370
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9525	
CLOSING SPOT RATE			6.9706	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-169.2	-367.2	-924.2	-1448.2	-1914.2
2M		-198	-755	-1279	-1745
3M			-557	-1081	-1547
6M				-524	-990
9M					-466



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