



【2023-03-07】

今日美元/人民币中间价报 6.9156，较上一个交易日上调 205bp，全天掉期市场交投活跃。

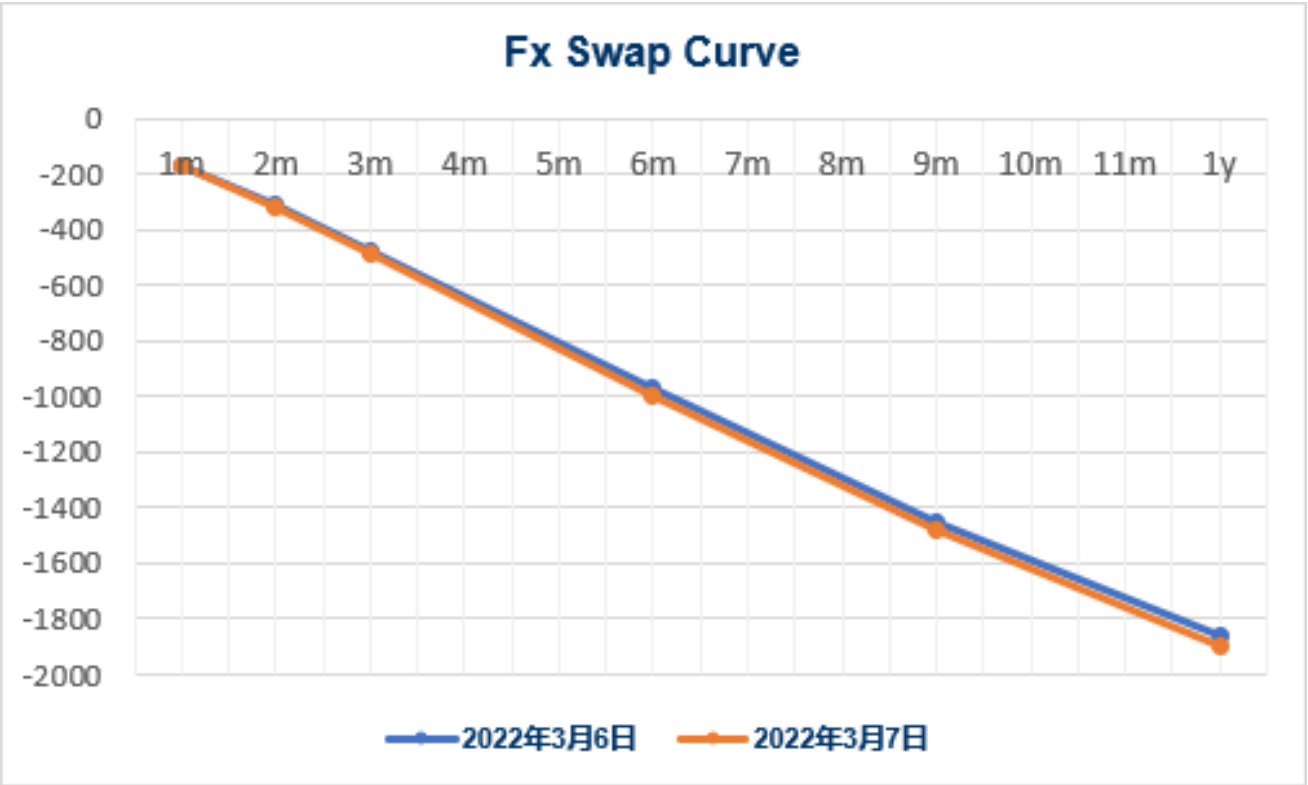
O/N 成交在-6.45~-6.28；T/N 从-6.5 一直拿到-6.25，后面又给到-6.35 左右；S/N 成交在-6.3~-6.1； 1w 成交在-41.7~-40.7，集中成交在-41.6， -41.5； 3w 成交在-114； 1s 成交在-166.1， -165.5； 2s 成交在-315； 3s 从-482 一路给到-485。

中长期限， 6s 成交在-989~-995； 9s 成交在-1477， -1480； 1y 集中成交在-1900， -1896， -1895； 2y 成交在-2800， -2775。

Spread 方面， 3s*9s 成交在-995， 6s*1y 成交在-903。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-42	6.9227	-0.55
2W	14	-78	6.9190	-1
1M	32	-166	6.9102	1.8
2M	61	-317	6.8951	-3
3M	92	-485	6.8783	-8
6M	186	-996	6.8272	-24
9M	277	-1476	6.7792	-27
1Y	368	-1895	6.7373	-33
18M	550	-2480	6.6788	-30
2Y	732	-2740	6.6528	-40
3Y	1096	-2980	6.6288	-30
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9156	
CLOSING SPOT RATE			6.9268	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-150.9	-318.9	-829.9	-1309.9	-1728.9
2M		-168	-679	-1159	-1578
3M			-511	-991	-1410
6M				-480	-899
9M					-419



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