



【2023-04-25】

今日美元/人民币中间价报 6.8847，较上一个交易日上调 12bp，全天掉期市场交投活跃。

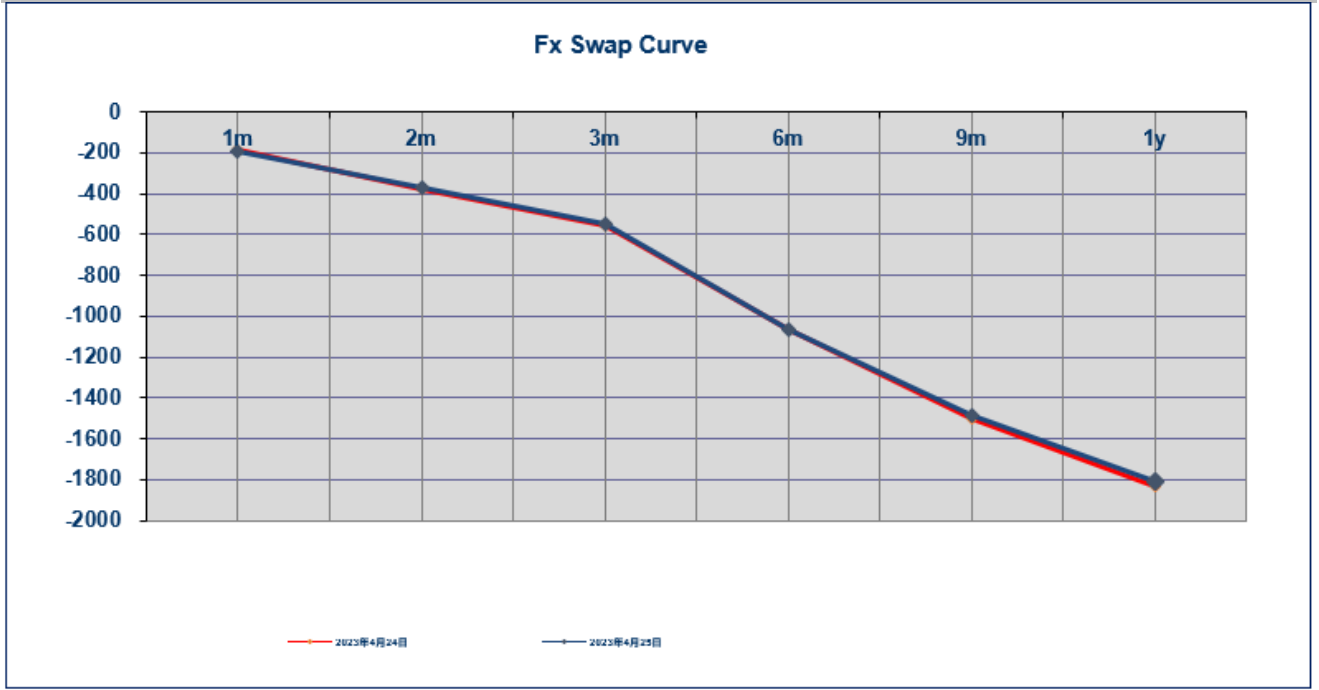
O/N 成交在-6.1~5.7；T/N 从-5.8 买到-5.3，后面又给到-5.5 左右；S/N 成交在-5.8~-5.58；1w 成交在-40~-36.95；2w 成交在-81.5~-80.5；3s 成交在-548。中长期限，6s 成交在-1060；1y 成交在-1819。

超长期限，2y 成交在-2320，-2330。

Spread 方面，1w\*2w 成交在-43.55；2w\*3w 成交在-43.5；2w\*1s 成交在-115；1s\*2s 成交在-175.5；2s\*3s 成交在-179；9s\*1y 成交在-326，-319；6s\*1y 成交在-751；1y\*2y 成交在-500，-520。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 7    | -37        | 6.9126       | 8.23       |
| 2W                      | 14   | -80        | 6.9083       | 4          |
| 1M                      | 34   | -196       | 6.8967       | -12.8      |
| 2M                      | 62   | -371       | 6.8792       | 6          |
| 3M                      | 90   | -551       | 6.8612       | 3          |
| 6M                      | 182  | -1065      | 6.8098       | 0          |
| 9M                      | 274  | -1488      | 6.7675       | 14         |
| 1Y                      | 365  | -1810      | 6.7353       | 25         |
| 18M                     | 548  | -2170      | 6.6993       | 0          |
| 2Y                      | 731  | -2370      | 6.6793       | -70        |
| 3Y                      | 1098 | -2350      | 6.6813       | 0          |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 6.8847       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 6.9163       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |      |      |      |       |       |
|---------------------|------|------|------|-------|-------|
|                     | 2M   | 3M   | 6M   | 9M    | 1Y    |
| 1M                  | -175 | -355 | -869 | -1292 | -1614 |
| 2M                  |      | -180 | -694 | -1117 | -1439 |
| 3M                  |      |      | -514 | -937  | -1259 |
| 6M                  |      |      |      | -423  | -745  |
| 9M                  |      |      |      |       | -322  |



文 / Edison Zeng

联系人：Rafael Wong  
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推介、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，所有前述和保证均明确免责声明。