



【2023-04-11】

今日美元/人民币中间价报 6.8882，较上一个交易日上调 118bp，全天掉期市场交投活跃。

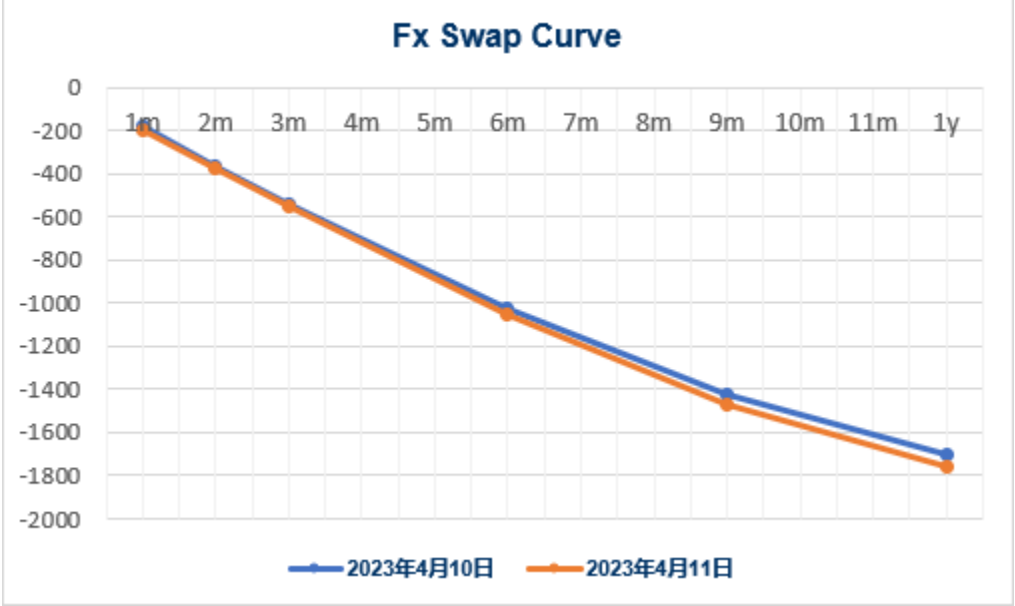
O/N 成交在 -6.6， -6.69； T/N 成交在 -6.67~-6.5； S/N 成交在 -6.65~-6.61； 1w 成交在 -44~-43.5； 1s 成交在 -194， -194.3； 2s 成交在 -373； 3s 成交在 -549， 后面给到 -553.5， -554。

中长期限， 6s 成交在 -1050； 9s 成交在 -1470~-1460， 后面收在 -1467 附近； 1y 早上成交在 -1740， -1750， -1755， 下午从 -1770 给到 -1775， 后面又拿到 -1755 附近。

Spread 方面， 2s*3s 成交在 -181； 3s*6s 成交在 -500； 9s*1y 成交在 -294。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	6.8803	-0.15
2W	14	-86	6.8761	0
1M	32	-195	6.8653	-13.5
2M	61	-372	6.8475	-6
3M	91	-552	6.8295	-12
6M	183	-1050	6.7797	-24
9M	278	-1469	6.7378	-44
1Y	368	-1758	6.7089	-52
18M	551	-2110	6.6737	-55
2Y	732	-2180	6.6667	-80
3Y	1096	-2200	6.6647	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8882	
CLOSING SPOT RATE			6.8847	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-177.25	-357.5	-855.5	-1274.5	-1563.5
2M		-180.25	-678.25	-1097.25	-1386.25
3M			-498	-917	-1206
6M				-419	-708
9M					-289



文 / Edison Zeng