

收盘日评
银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2023-04-19】

今日美元/人民币中间价报 6.8731，较上一个交易日下调 83bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

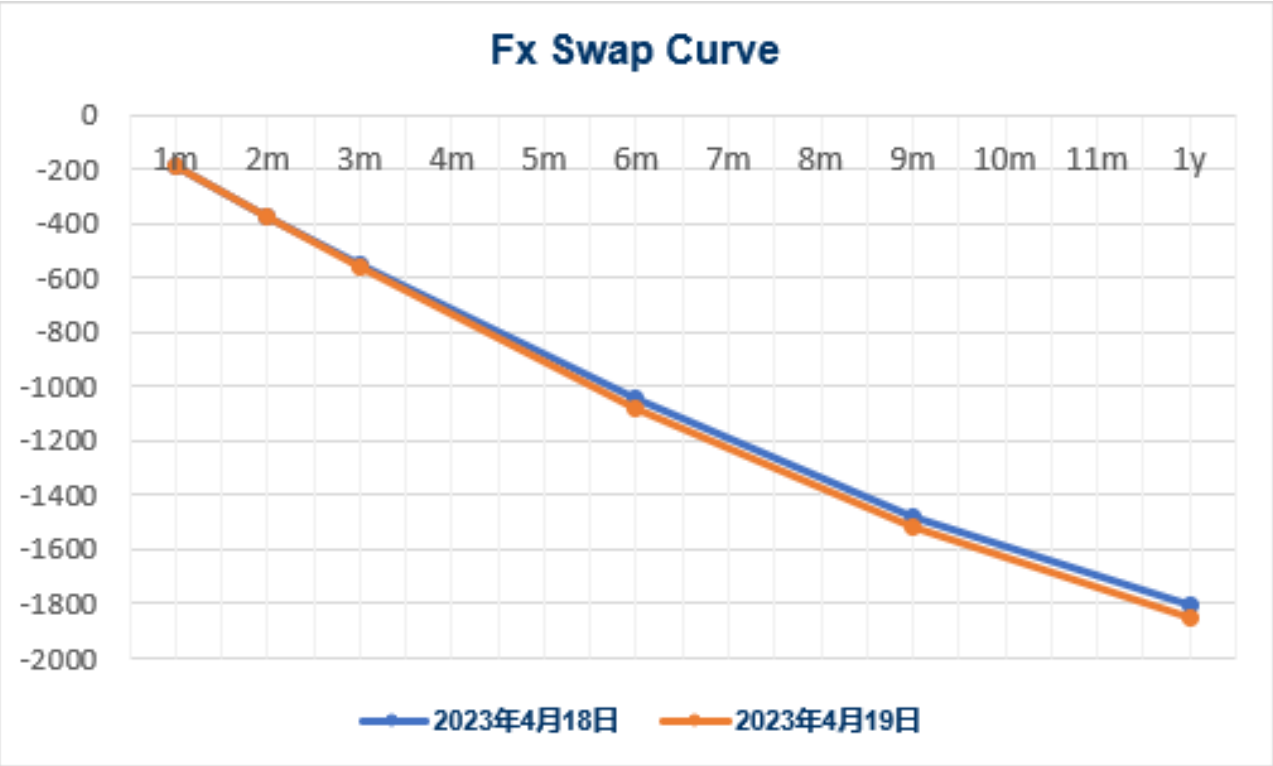
ON 成交在-5.2~-5 之间，午后成交在-5.15 附近； TN 成交在-5.45~-5.3 之间，午后成交在-5.36~-5.35 附近； SN 成交在-16.8~-16.6 之间。1W 成交在-40.5~-40.2 之间； 2W 成交在-81.35~-81 之间。1S 成交在-186.5~-186.2 之间； 2S 成交在-375.5~-373 附近； 3S 成交在-555~-552 之间； 5S 从-905 给到-907。

中长期限，6S 从-1070 给到-1077； 9S 成交在-1515~-1498 附近； 1Y 从-1843 给到-1846。

Spread 方面，1W*2W 成交在-40.8， 2W*1S 成交在-105， 3*6S 成交在-518、-519、-520， 5*6S 成交在-169、-170， 6*12S 成交在-770。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	6.8926	-0.04
2W	14	-81	6.8885	0
1M	31	-187	6.8779	3.4
2M	61	-376	6.8591	-5
3M	91	-556	6.8410	-6
6M	185	-1080	6.7886	-35
9M	276	-1515	6.7451	-30
1Y	367	-1855	6.7111	-52
18M	549	-2270	6.6696	-20
2Y	731	-2450	6.6516	-120
3Y	1096	-2690	6.6276	-140
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8731	
CLOSING SPOT RATE			6.8966	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-188.9	-369.4	-893.4	-1328.4	-1668.4
2M		-180.5	-704.5	-1139.5	-1479.5
3M			-524	-959	-1299
6M				-435	-775
9M					-340



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