



【2023-03-01】

今日美元/人民币中间价报 6.9400，较上一个交易日下调 119bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-5.45~-5.1；T/N 从-5.1 一路给到-5.3，后面又买到-4.95 左右，收在-5.1；S/N 成交在-15.6~-15，集中成交在-15.6，-15.5，-15；1w 成交在-35.5~-34.9；2w 成交在-69.3~-68；3w 成交在-101；1s 从-149 买到-146.5；3s 成交在-475~-462.5。

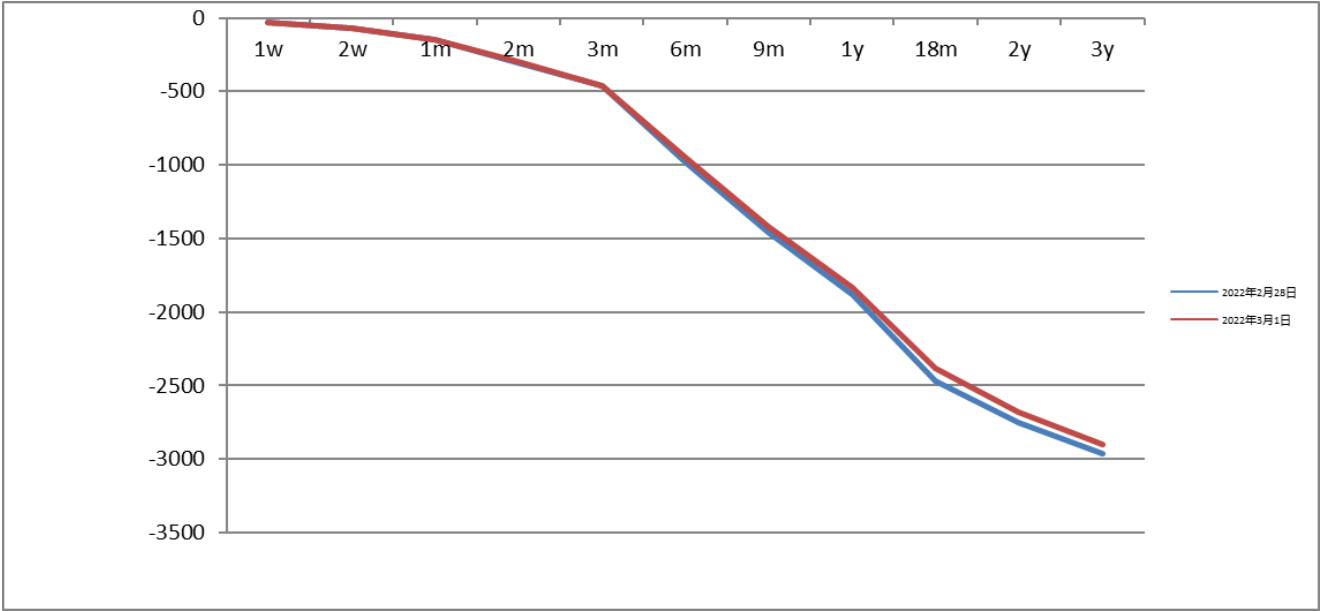
中长期限，6s 成交在-953~-951；9s 成交在-1445 一路买到-1422，后面收在-1425 附近；1y 从-1865 买到-1837；2y 成交在-2710，-2680。

超长期限，5y 成交在-3450。

Spread 方面，1w*2w 成交在-34；6s*1y 成交在-886，-882；9s*1y 成交在-417；1y*2y 成交在-860，-845，-840。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-35	6.8819	-0.6
2W	14	-68	6.8786	0
1M	32	-146	6.8708	5.9
2M	63	-296	6.8558	13
3M	92	-464	6.8390	0.5
6M	187	-950	6.7904	30
9M	277	-1420	6.7434	37
1Y	368	-1835	6.7019	50
18M	551	-2380	6.6474	90
2Y	732	-2680	6.6174	70
3Y	1096	-2900	6.5954	66
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9400	
CLOSING SPOT RATE			6.8854	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-150	-318	-804	-1274	-1689
2M		-168	-654	-1124	-1539
3M			-486	-956	-1371
6M				-470	-885
9M					-415



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