



【2023-03-28】

今日美元/人民币中间价报 6.8749，较上一个交易日上调 35bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-7.01~-6.95；T/N 成交在-7.17~-6.9，集中成交在-6.9；S/N 成交在-7.05~-6.9； 1w 成交在-47.7~-46.5；2w 成交在-94~-93.7；1s 成交在-186~-185.5； 3s 成交在-566，-565。

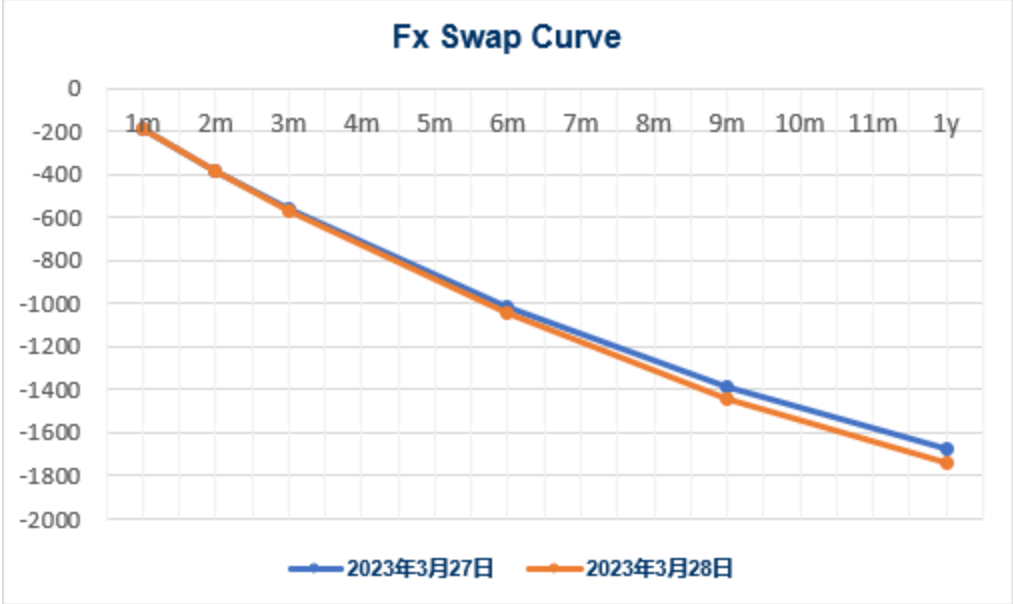
中长期限，6s 从-1024 一路给到-1042 左右；1y 从-1705 给到-1740，后面又拿到-1730，最后收盘又给到-1740 附近。

超长期限， 2y 成交在-2200。

Spread 方面，2w*1s 成交在-92；2s*3s 成交在-182； 6s*1y 成交在-698~-680。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	6.8798	7.2
2W	14	-94	6.8752	0
1M	29	-186	6.8660	6.5
2M	61	-383	6.8462	3
3M	92	-565	6.8280	-8
6M	182	-1042	6.7803	-29
9M	274	-1442	6.7403	-54
1Y	365	-1745	6.7100	-67
18M	550	-2100	6.6745	-160
2Y	732	-2222	6.6623	-172
3Y	1096	-2245	6.6600	-124
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8749	
CLOSING SPOT RATE			6.8845	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-197.5	-379.5	-856.5	-1256.5	-1559.5
2M		-182	-659	-1059	-1362
3M			-477	-877	-1180
6M				-400	-703
9M					-303



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