



【2023-04-04】

今日美元/人民币中间价报 6.8699，较上一个交易日下调 106bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-13.45~-12.7；T/N 成交在-6.5~-6.3；S/N 成交在-19.08~-19； 1w 成交在-43.4~-43.3；2w 成交在-84.7；1s 成交在-181； 2s 成交在-356.5；4s 成交在-698。

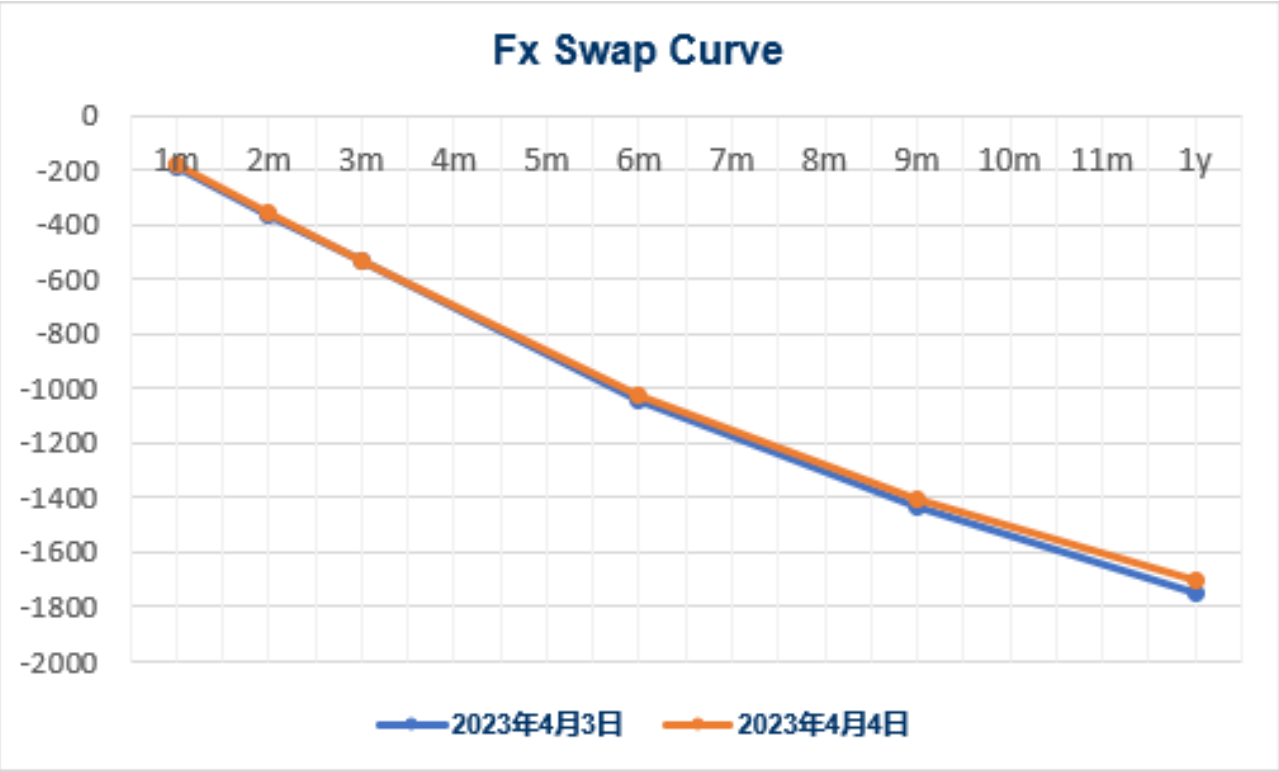
中长期限，6s 成交在-1020；1y 从-1710 买到-1700，最后收盘又给到-1709 附近。

超长期限， 2y 成交在-2100。

Spread 方面， 1w*2w 成交在-41.8。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	6.8759	0.05
2W	14	-85	6.8717	1
1M	31	-181	6.8621	5
2M	61	-357	6.8445	4
3M	91	-530	6.8272	6
6M	186	-1023	6.7779	17
9M	276	-1410	6.7392	28
1Y	367	-1707	6.7095	42
18M	550	-2065	6.6737	55
2Y	731	-2100	6.6702	130
3Y	1096	-2225	6.6577	165
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8699	
CLOSING SPOT RATE			6.8802	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-176	-349	-842	-1229	-1526
2M		-173	-666	-1053	-1350
3M			-493	-880	-1177
6M				-387	-684
9M					-297



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