



【2023-03-22】

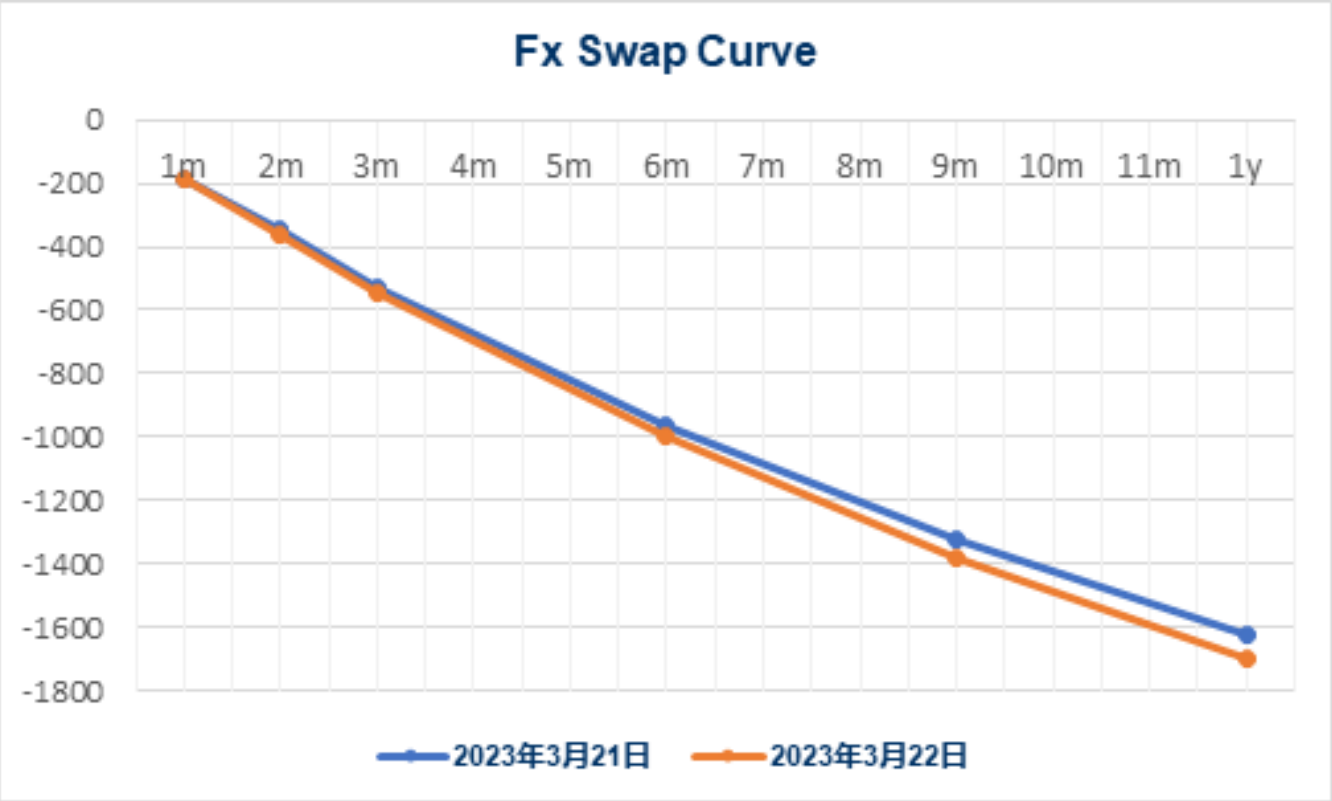
今日美元/人民币中间价报 6.8715，较上一个交易日下调 48bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 成交在-5.3~-5.2 之间； TN 早盘在-5.95~5.8 之间来回成交，午后给到-6.1，尾盘收在-5.95 附近； SN 成交在-17.9~-17.8 之间。1W 从-42.2 给到-41.75； 2W 成交在-83~-82 之间。1S 成交在-185~-183.5 之间； 2S 成交在-358.5~-347.5 附近； 3S 成交在-546~-537 附近。

中长期限， 6S 成交在-1002.5~-988 附近； 9S 成交在-1380~-1375 之间； 1Y 从-1675 买到-1670，后一路给到-1700，尾盘收在-1700。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	0	6.8903	40
2W	14	0	6.8903	81
1M	31	0	6.8903	182.5
2M	61	0	6.8903	347
3M	94	0	6.8903	528
6M	185	0	6.8903	965
9M	277	0	6.8903	1325
1Y	367	0	6.8903	1621
18M	550	0	6.8903	1900
2Y	731	0	6.8903	2120
3Y	1096	0	6.8903	2200
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8715	
CLOSING SPOT RATE			6.8903	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-173	-360.5	-814.5	-1194.5	-1514.5
2M		-187.5	-641.5	-1021.5	-1341.5
3M			-454	-834	-1154
6M				-380	-700
9M					-320



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