



【2023-02-07】

今日美元/人民币中间价报 6.7967，较上一个交易日上调 230bp，全天掉期市场交投活跃。

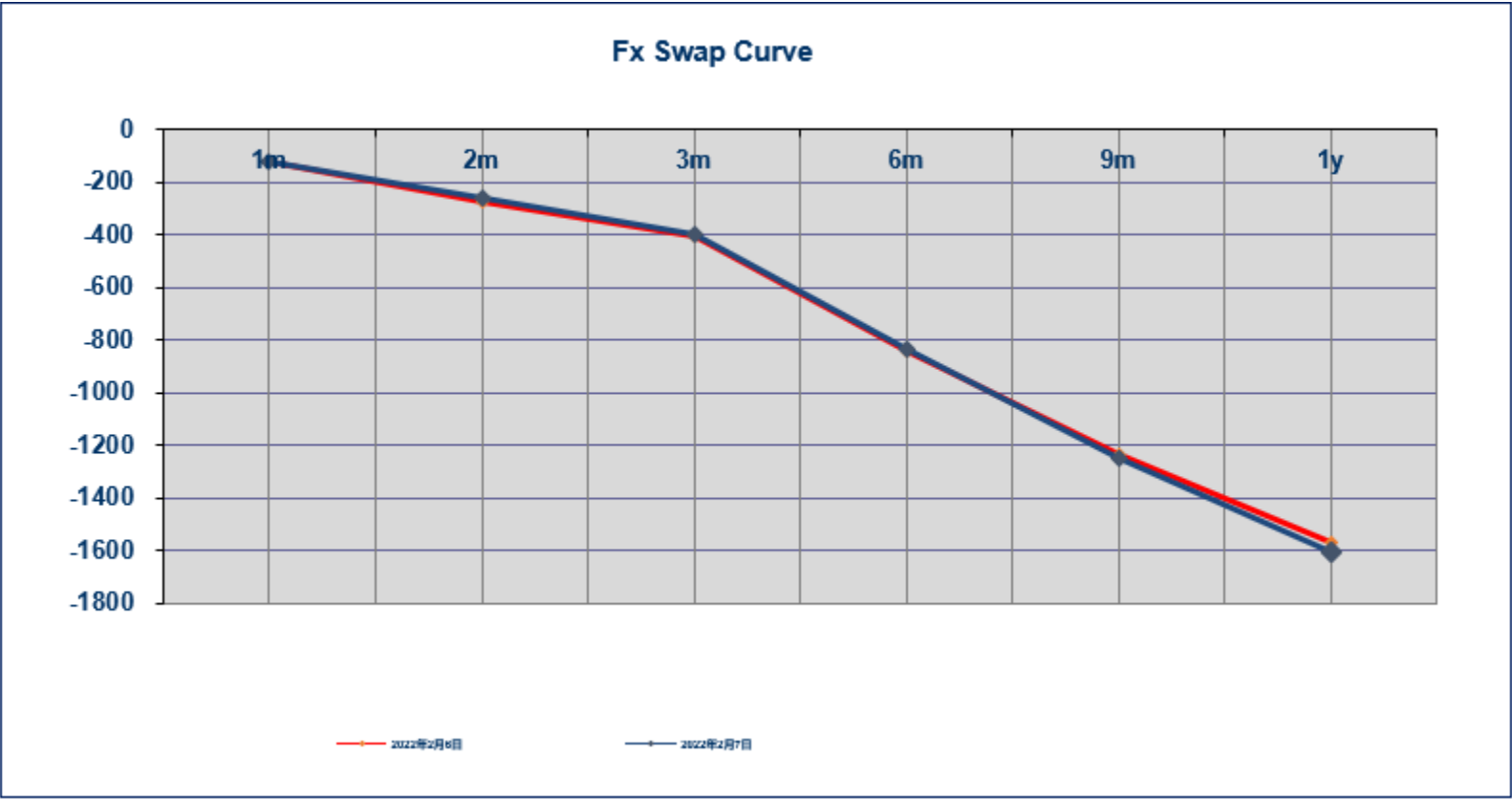
O/N 成交在-3.2；T/N 成交在-4.3 一路买到-3.88，收在-3.93 附近；S/N 成交在-4.1~-4；1w 成交在-28.5，-28.3；1s 成交在-121，-120；2s 成交在-263，-262；3s 成交在-400，-395。

中长期限，6s 从-835 一路给到-839；9s 成交在-1232，-1230；1y 从 1600 买到-1580，反复成交在-1585 附近，后面又给到-1605，-1610；2y 成交在-2020，-2030；

Spread 方面，1s*2s 成交在-142；3s*6s 成交在-438；9s*1y 成交在-360~-355；1y*2y 成交在-441。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-28	6.7848	2.7
2W	14	-59	6.7817	2
1M	28	-123	6.7753	3
2M	60	-265	6.7611	11
3M	89	-401	6.7475	9
6M	181	-838	6.7038	5
9M	273	-1247	6.6629	-13
1Y	372	-1608	6.6268	-37
18M	547	-1950	6.5926	-40
2Y	732	-2052	6.5824	-92
3Y	1096	-2050	6.5826	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7967	
CLOSING SPOT RATE			6.7876	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-142	-278	-715	-1124	-1485
2M		-136	-573	-982	-1343
3M			-437	-846	-1207
6M				-409	-770
9M					-361



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