



【2023-02-22】

今日美元/人民币中间价报 6.8759，较上一个交易日上调 202bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

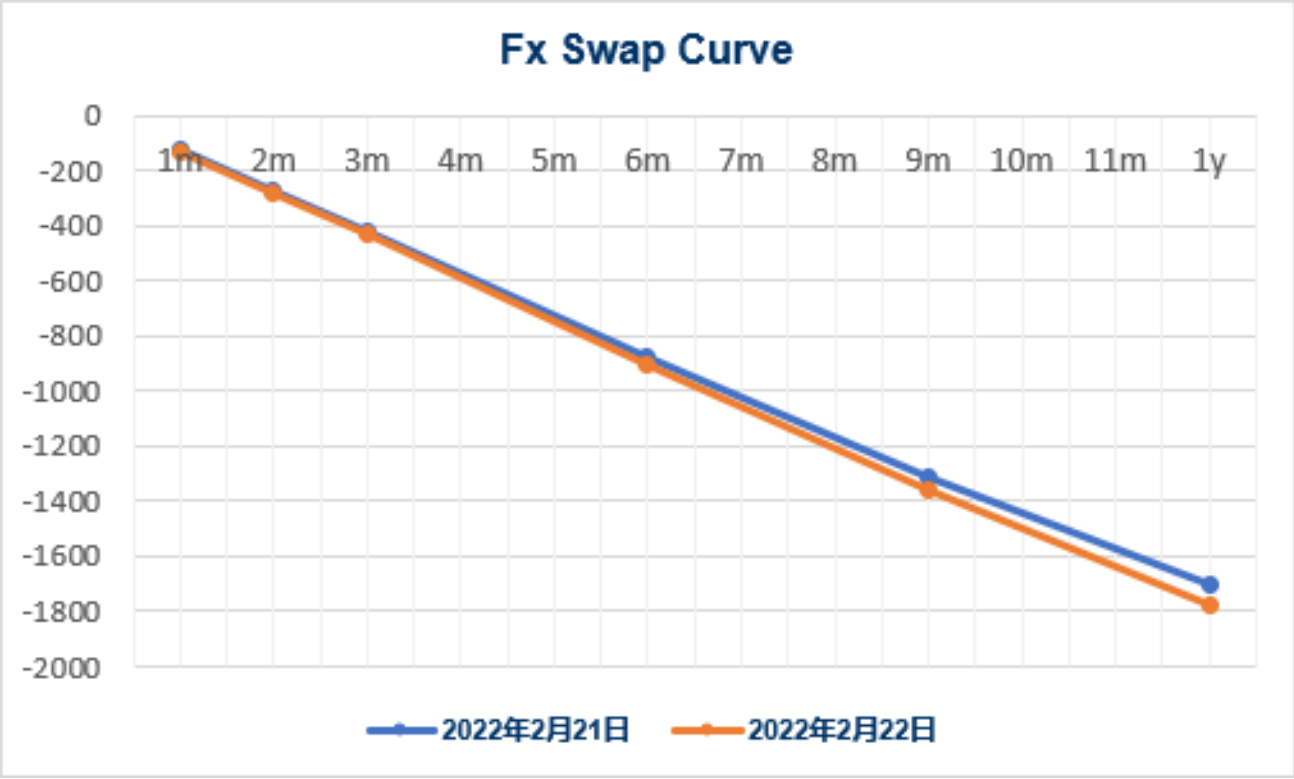
ON 成交在-5.5~-5 之间；TN 从早盘-4.8 一路给到-5.23；SN 从早盘-14.3 一路给到-14.7。1W 从-31.5 给到-31.8；2W 成交在-63.5~-63 附近。1S 成交在-129.8~-129.4 之间；2S 成交在-281~-279 附近；3S 成交在-432~-430 附近。

中长期限，6S 成交在-904~-896 之间；9S 成交在-1356~-1354 之间；1Y 反复成交在-1755~-1750 之间，午后给到-1780。

Spread 方面，1S*2S 成交在-151，6*9S 成交在-456。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-32	6.8921	-1.5
2W	14	-64	6.8890	-1
1M	28	-130	6.8824	-5.1
2M	59	-281	6.8673	-6
3M	89	-431	6.8522	-13.5
6M	181	-900	6.8053	-28
9M	273	-1355	6.7598	-41
1Y	367	-1775	6.7178	-70
18M	549	-2250	6.6703	-50
2Y	731	-2530	6.6423	-130
3Y	1096	-2700	6.6253	-200
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8759	
CLOSING SPOT RATE			6.8953	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-151	-301.5	-770.5	-1225.5	-1645.5
2M		-150.5	-619.5	-1074.5	-1494.5
3M			-469	-924	-1344
6M				-455	-875
9M					-420



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