



【2023-04-18】

今日美元/人民币中间价报 6.8814，较上一个交易日上调 135bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-5.5~-5.14；T/N 从-5.75 一路买到-5.4 左右，后面给到-5.65 附近然后又一路买到-5.1；S/N 成交在-5.5； 1w 成交在-41~-40.5；2w 成交在-81.8，-81.6；1s 成交在-191.5~-189.5； 2s 成交在-373.5~-365，集中成交在-373；3s 成交在-553~-551。

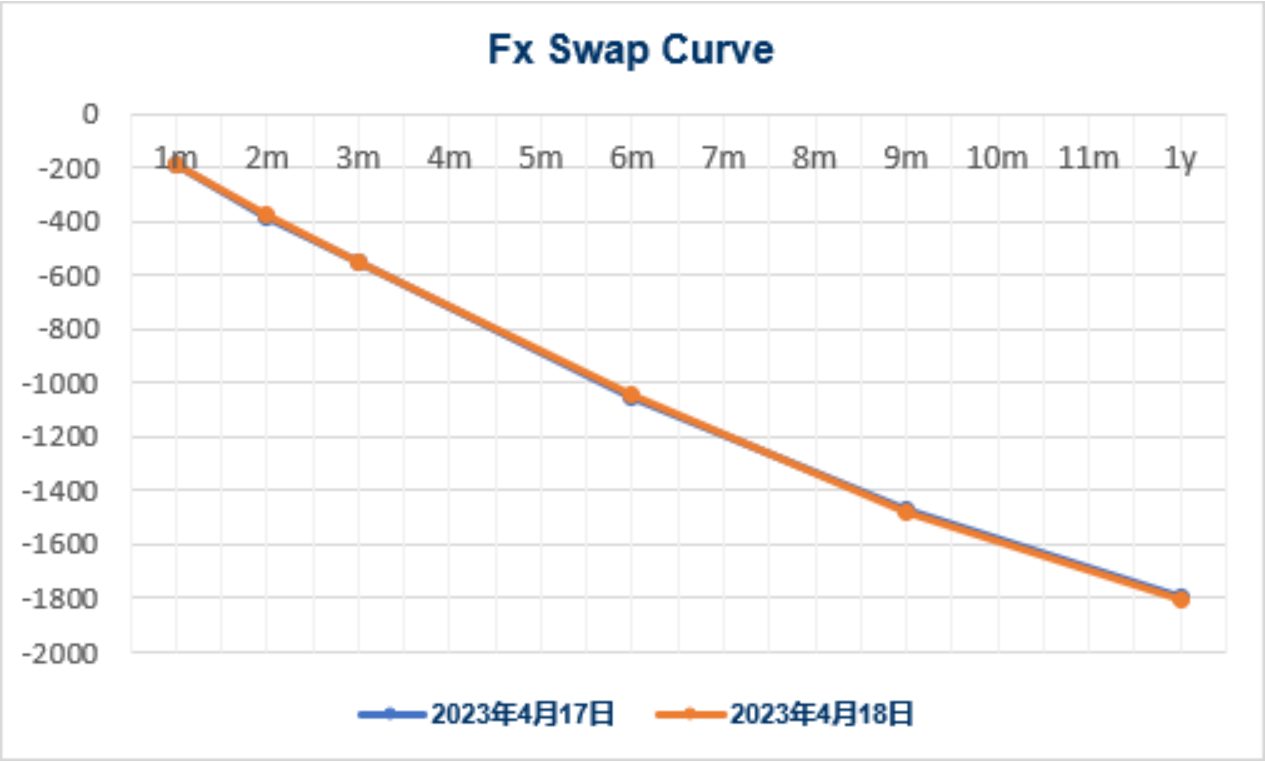
中长期限，5s 成交在-892；6s 成交在-1060~-1045；9s 成交在-1484；1y 从-1800 给到-1817 附近，后面又拿到-1815，-1813，-1810，一直拿到-1800，后面收在-1803 附近。

超长期限，3y 成交在-2569，-2520；

Spread 方面，1w*2w 成交在-40.7；1s*2s 成交在-181.5； 2s*3s 成交在-180，-179；3s*6s 成交在-502~-500； 5s*6s 成交在-157，-156；3s*1y 成交在-1261；1y*2y 成交在-560。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	6.8709	2.5
2W	14	-81	6.8668	10
1M	32	-190	6.8559	-6
2M	61	-371	6.8378	9
3M	91	-550	6.8199	1
6M	183	-1045	6.7704	6
9M	277	-1485	6.7264	-10
1Y	368	-1803	6.6946	-8
18M	550	-2250	6.6499	0
2Y	732	-2330	6.6419	-55
3Y	1096	-2550	6.6199	-150
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8814	
CLOSING SPOT RATE			6.8749	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-181	-360	-855	-1295	-1613
2M		-179	-674	-1114	-1432
3M			-495	-935	-1253
6M				-440	-758
9M					-318



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