



【2023-02-14】

今日美元/人民币中间价报 6.8136，较上一个交易日下调 15bp，全天掉期市场交投活跃。

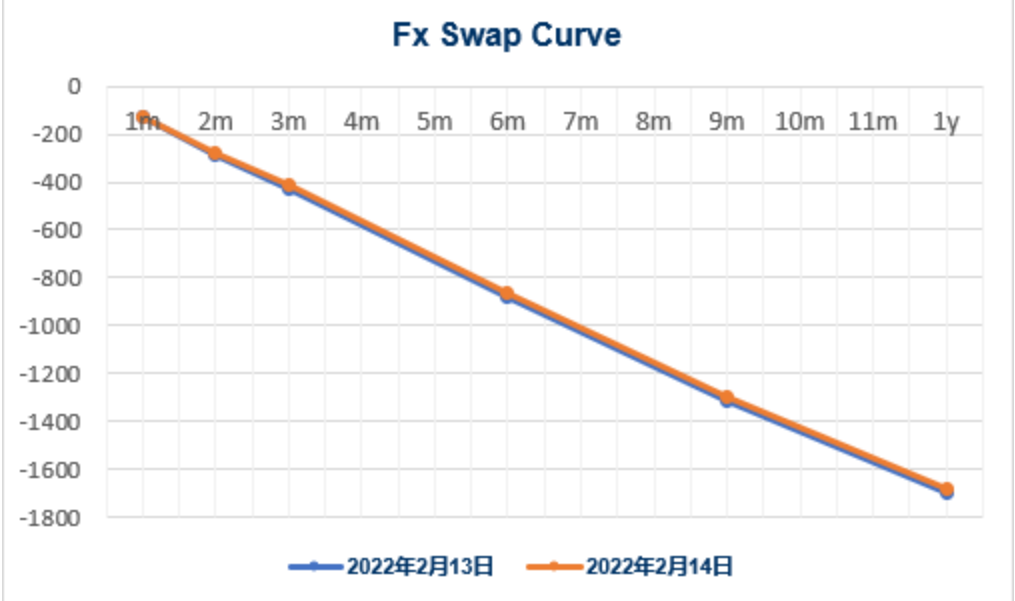
O/N 成交在-4.75~-4.65；T/N 成交在-4.7 买到-4.63，后面又给到-4.7 附近；S/N 成交在-4.63~-4.65；1w 成交在-32，-31.9，-31.85，-31.75；2w 成交在-62.35~-61.5；1s 成交在-125.5~-125；2s 成交在-274，-275；3s 成交在从-412 一直给到-417.5 附近。

中长期限，6s 从-870 一路买到-858，-857，尾盘收在-860 附近；9s 成交在-1295，-1292；1y 从-1680，-1683 给到-1685，后面又买到-1672，1670，尾盘收在-1675 附近；18s 成交在-2100，-2108，-2105；3y 成交在-2325；

Spread 方面，1w*2w 成交在-30；3s*6s 成交在-445；6s*1y 成交在-812；1y*18s 成交在-425。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-32	6.8133	1.35
2W	14	-70	6.8095	-6
1M	28	-125	6.8040	3.2
2M	60	-275	6.7890	12
3M	89	-414	6.7752	12.5
6M	181	-861	6.7304	22
9M	273	-1296	6.6869	18
1Y	365	-1680	6.6485	20
18M	547	-2100	6.6065	80
2Y	733	-2250	6.5915	80
3Y	1103	-2320	6.5845	30
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.8136	
CLOSING SPOT RATE			6.8165	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-150	-288.5	-736	-1171	-1555
2M		-138.5	-586	-1021	-1405
3M			-447.5	-882.5	-1266.5
6M				-435	-819
9M					-384



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