



【2023-08-01】

今日美元/人民币中间价报 7.1283，较上一个交易日下调 22bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-7.6； T/N 成交在-7.64~-7.15； S/N 成交在-7.62~-7.5； 1w 成交在-53~-51； 2w 成交在-104.5, -104.4, -104； 1s 成交在-244.5, -244； 3s 成交在-688, -686, -685。

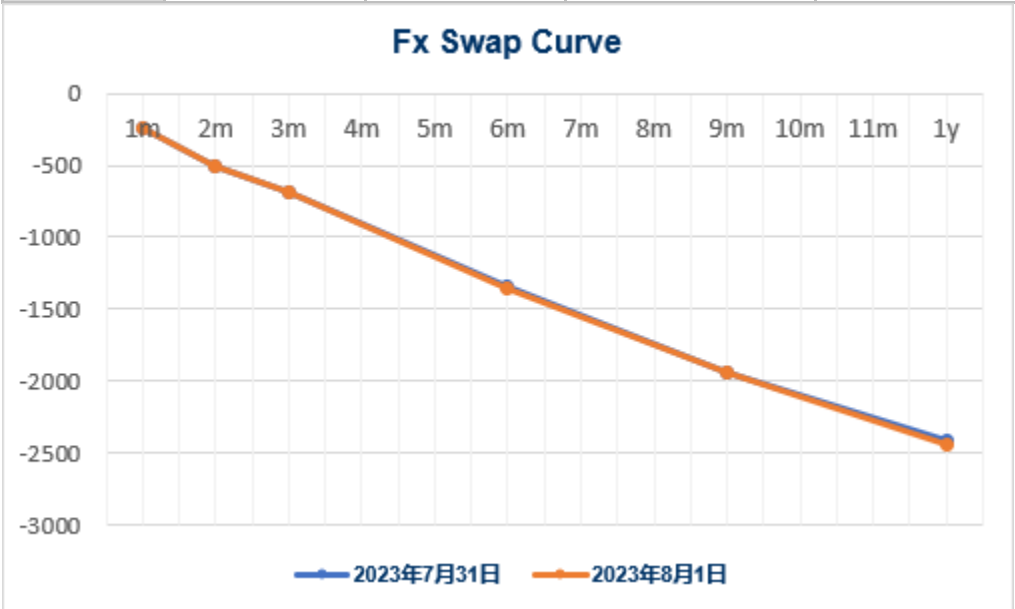
中长期限， 6s 成交在-1358, -1354； 1y 成交在-2455, -2460, -2450, -2445。

超长期限， 2y 成交在-3755。

Spread 方面， 1s*2s 成交在-260； 1s*3s 成交在-441； 3s*6s 成交在-672, -671, -670； 9s*1y 成交在-495； 1y*2y 成交在-1300, -1290。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.1611	-0.99
2W	14	-104	7.1559	-1
1M	33	-244	7.1419	4
2M	68	-502	7.1161	8
3M	92	-686	7.0977	-2
6M	186	-1357	7.0306	-21
9M	277	-1939	6.9724	-1
1Y	368	-2440	6.9223	-20
18M	551	-3185	6.8478	25
2Y	732	-3740	6.7923	-10
3Y	1096	-4480	6.7183	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1283	
CLOSING SPOT RATE			7.1663	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-258	-442	-1113	-1695	-2196
2M		-184	-855	-1437	-1938
3M			-671	-1253	-1754
6M				-582	-1083
9M					-501



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