



【2023-08-10】

今日美元/人民币中间价报 7.1576，较上一个交易日下调 12bp，各期限收盘价较上一交易日略微上行。

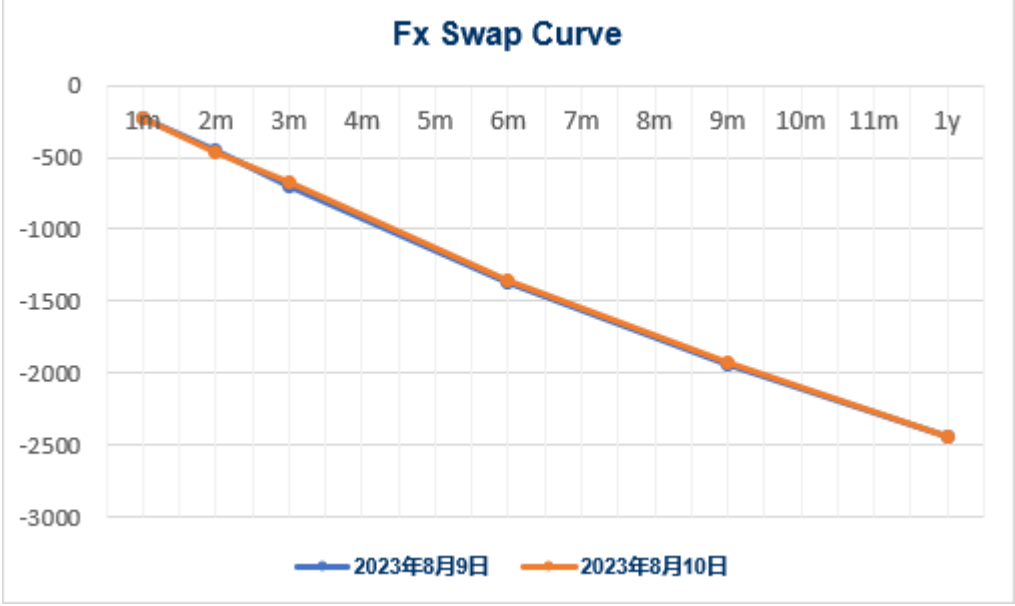
ON 早盘从-7.3 买到-7.15，午后从-7.17 买到-7.14；TN 早盘从-19.8 给到-20.95，午后从-20.76 买到-20.5；SN 从-6.94 买到-6.91。1W 成交在-48.3 附近；2W 成交在-102~-99.5 附近。1S 从-226.5 买到-224.5；2S 成交在-466~-450 附近；3S 在-688~-686 之间来回成交，午后买到-683~-682 位置。

中长期限，6S 从-1362 一路买到-1355，尾盘成交在-1355；9S 成交在-1937~-1930 附近；1Y 从-2460 买到-2456，后从-2461 买到-2453。

Spread 方面，9*12S 成交在-524、-520、-518，1*3Y 成交在-2075。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.2024	-0.9
2W	14	-100	7.1973	-2
1M	31	-224	7.1848	0.5
2M	63	-462	7.1611	-17
3M	92	-680	7.1392	15
6M	186	-1354	7.0718	18
9M	274	-1930	7.0142	5
1Y	366	-2445	6.9627	0
18M	550	-3250	6.8822	50
2Y	731	-3800	6.8272	-60
3Y	1096	-4525	6.7547	-25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1576	
CLOSING SPOT RATE			7.2072	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-237.5	-456	-1130	-1706	-2221
2M		-218.5	-892.5	-1468.5	-1983.5
3M			-674	-1250	-1765
6M				-576	-1091
9M					-515



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。