



【2023-08-08】

今日美元/人民币中间价报 7.1565，较上一个交易日上调 185bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-6.5， -6.2； T/N 成交在-6.9~-6.25； S/N 成交在-6.83~-6.4； 1w 成交在-48， -47.5， -47.3， -47.1； 3w 成交在-148.5； 1s 成交在-231； 3s 成交在-676。

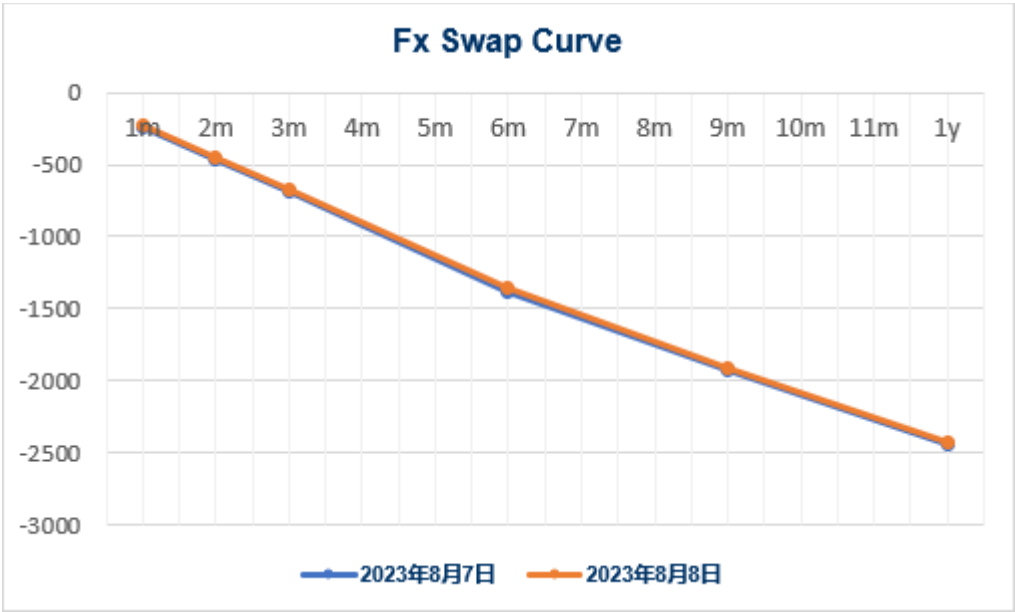
中长期限， 5s 成交在-1110； 6s 成交在-1372； 9s 成交在-1925， -1917， -1915； 1y 成交在-2446， -2445， -2440， 后面一路买到-2438， -2435， -2428， -2432， -2430。

超长期限， 3y 成交在-4450。

Spread 方面， 3s*6s 成交在-696； 9s*1y 成交在-517； 1y*3y 成交在-2030。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-47	7.2086	2.4
2W	14	-96	7.2037	6
1M	32	-229	7.1904	12
2M	61	-445	7.1688	15
3M	92	-675	7.1458	9
6M	190	-1360	7.0773	30
9M	274	-1912	7.0221	21
1Y	368	-2435	6.9698	11
18M	550	-3200	6.8933	150
2Y	732	-3730	6.8403	30
3Y	1096	-4450	6.7683	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1565	
CLOSING SPOT RATE			7.2133	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-216	-446	-1131	-1683	-2206
2M		-230	-915	-1467	-1990
3M			-685	-1237	-1760
6M				-552	-1075
9M					-523



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