



【2023-07-18】

今日美元/人民币中间价报 7.1453，较上一个交易日上调 127bp，全天掉期市场交投活跃。

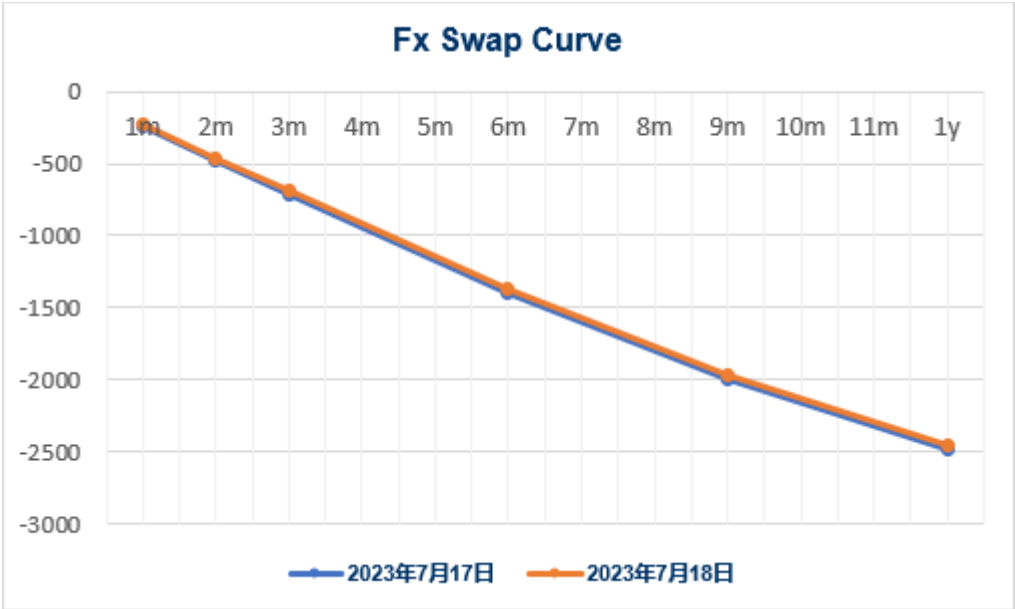
O/N 成交在-7.1， -7； T/N 最早成交在-7.3， -7.25， 后面一路买到-7.15， -6.85， -6.7， 最后收在-6.5 附近； S/N 成交在-7.22~-6.75； 1w 成交在-50.55~-48.2； 2w 成交在-102.2~-99； 1s 成交在-236~-234； 2s 成交在-467， -461； 3s 成交在-709~-690。

中长期限， 6s 成交在-1410~-1385； 9s 成交在-2000； 1y 开始成交在-2495， -2502， 后面买到-2490， -2488， 最后收在-2462 附近。

Spread 方面， 1w*2w 成交在-51.7； 2s*3s 成交在-231； 3s*6s 成交在-700； 6s*9s 成交在-590； 6s*1y 成交在-1080， -1079.5， -1077。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1668	2.6
2W	14	-99	7.1618	5
1M	32	-233	7.1485	14.5
2M	62	-458	7.1259	18
3M	92	-692	7.1025	19
6M	186	-1377	7.0341	29
9M	277	-1970	6.9747	29
1Y	368	-2458	6.9259	34
18M	551	-3250	6.8467	0
2Y	732	-3750	6.7967	60
3Y	1096	-4450	6.7267	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1453	
CLOSING SPOT RATE			7.1717	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-225.5	-459.5	-1144	-1737.5	-2225.5
2M		-234	-918.5	-1512	-2000
3M			-684.5	-1278	-1766
6M				-593.5	-1081.5
9M					-488



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