



【2023-08-22】

今日美元/人民币中间价报 7.1992，较上一个交易日上调 5bp，全天掉期市场交投活跃。

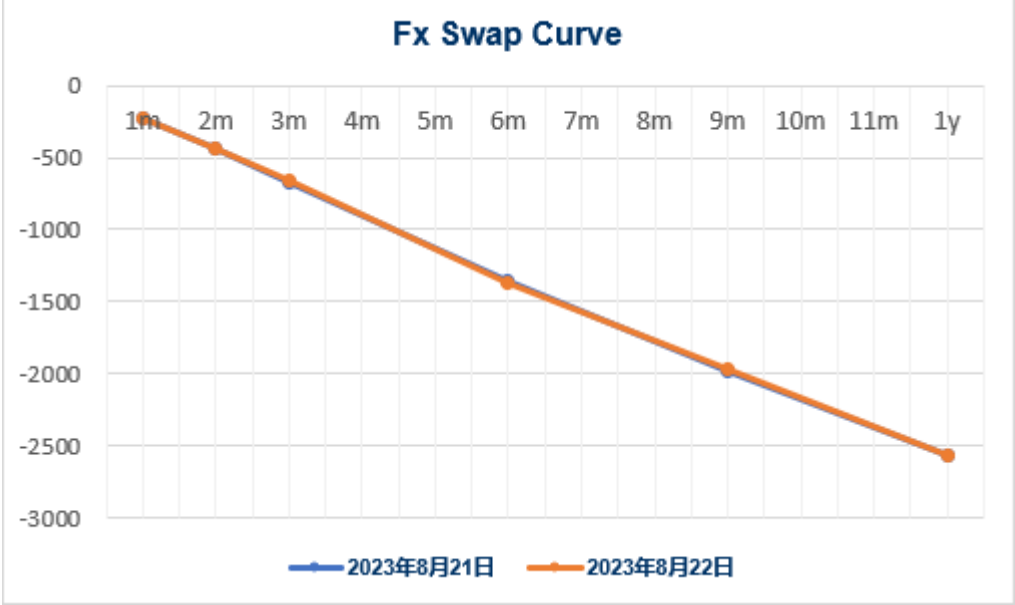
O/N 成交在-6.2； T/N 成交在-6.85~-6.3； 1w 成交在-46.9~-46.6； 2w 成交在-94， -93.5； 1s 成交在-221， -222， -218； 2s 成交在-436； 3s 成交在-663~-643； 4s 成交在-880。

中长期限， 6s 成交在-1342， -1335， -1330， -1327， 后面又一路给到-1357.5， -1363； 9s 成交在-1970， -1940； 1y 成交在-2500， -2517， 下午一路给到-2520， -2525， -2545， 最后收在-2570 附近。

Spread 方面， 2w*1s 成交在-127， -126； 2s*3s 成交在-227； 3s*6s 成交在-700， -688， -687； 6s*9s 成交在-613~-605； 9s*1y 成交在-580~-570。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-47	7.2888	-0.14
2W	14	-94	7.2841	1
1M	32	-225	7.2711	4.5
2M	61	-436	7.2499	-2
3M	92	-660	7.2275	15
6M	186	-1365	7.1570	-11
9M	274	-1970	7.0965	15
1Y	368	-2565	7.0370	5
18M	550	-3425	6.9510	90
2Y	732	-4200	6.8735	0
3Y	1096	-5100	6.7835	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1992	
CLOSING SPOT RATE			7.2935	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-211.5	-435.5	-1140.5	-1745.5	-2340.5
2M		-224	-929	-1534	-2129
3M			-705	-1310	-1905
6M				-605	-1200
9M					-595



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