



【2023-07-31】

今日美元/人民币中间价报 7.1305，较上一个交易日下调 33bp，各期限收盘价较上一交易日略微上行。

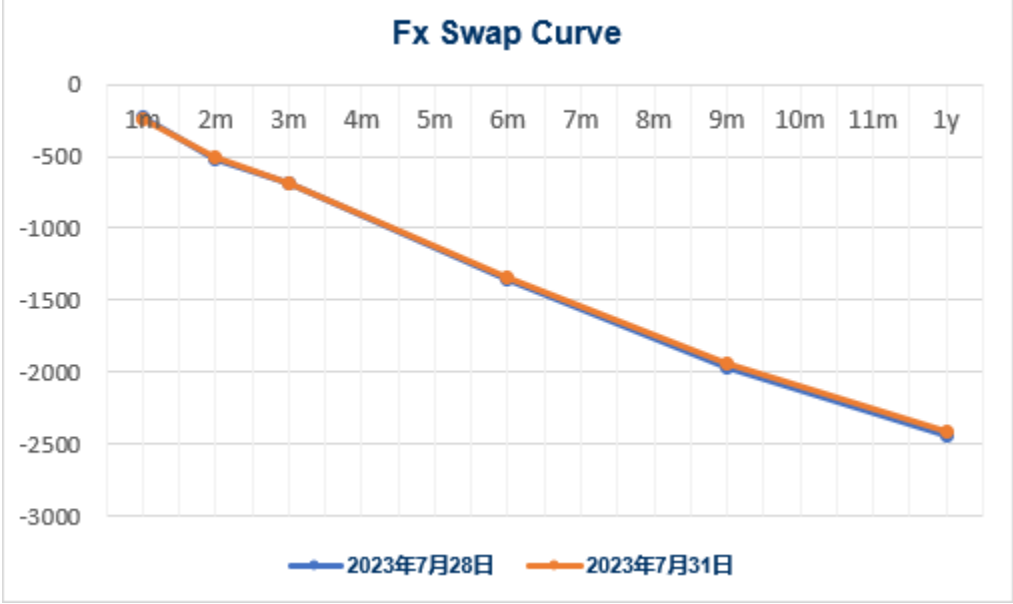
ON 成交在-7.2~-6.95 之间；TN 从-7.1 一路给到-7.21，后买回-7.19，尾盘给到-7.55；SN 成交在-7.32~-7.25 附近，尾盘收在-7.3。1W 在-51.5~-51.2 之间来回成交；2W 成交在-102 附近；3W 成交在-153 附近。1S 成交-249~-247.5 之间；2S 成交在-510~-509.5 附近；3S 成交在-685~-683 之间。

中长期限，6S 成交在-1337~-1336 之间；9S 成交在-1936~-1935 之间；1Y 成交在-2415~-2405 之间，尾盘收在-2415。

Spread 方面，3W*1S 成交在-94.5、-95，3*6S 成交在-654.5、-654、-653，6*9S 成交在-599.5、-599、-598.5。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.1414	0.49
2W	14	-103	7.1362	5
1M	34	-248	7.1217	-19
2M	69	-510	7.0956	11
3M	92	-684	7.0781	3.5
6M	184	-1336	7.0129	15
9M	274	-1938	6.9527	30
1Y	366	-2420	6.9045	18
18M	553	-3210	6.8255	30
2Y	731	-3730	6.7735	26
3Y	1097	-4480	6.6985	-15
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1305	
CLOSING SPOT RATE			7.1465	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-261.5	-436	-1088	-1690	-2172
2M		-174.5	-826.5	-1428.5	-1910.5
3M			-652	-1254	-1736
6M				-602	-1084
9M					-482



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。