



【2023-08-15】

今日美元/人民币中间价报 7.1768，较上一个交易日上调 82bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在 -6.5~-5.95； T/N 成交在 -6.6~-5.5； S/N 成交在 -6.6~-6； 1w 成交在 -47.1~-44； 2w 成交在 -96， -95， -92.5， -92； 1s 成交在 -228~-217； 2s 成交在 -441； 3s 成交在 -678， -673， -672， 下午一路买到 -666， -664， 后面又给到 -667， -668 附近，最后又买到 -665； 4s 成交在 -905。

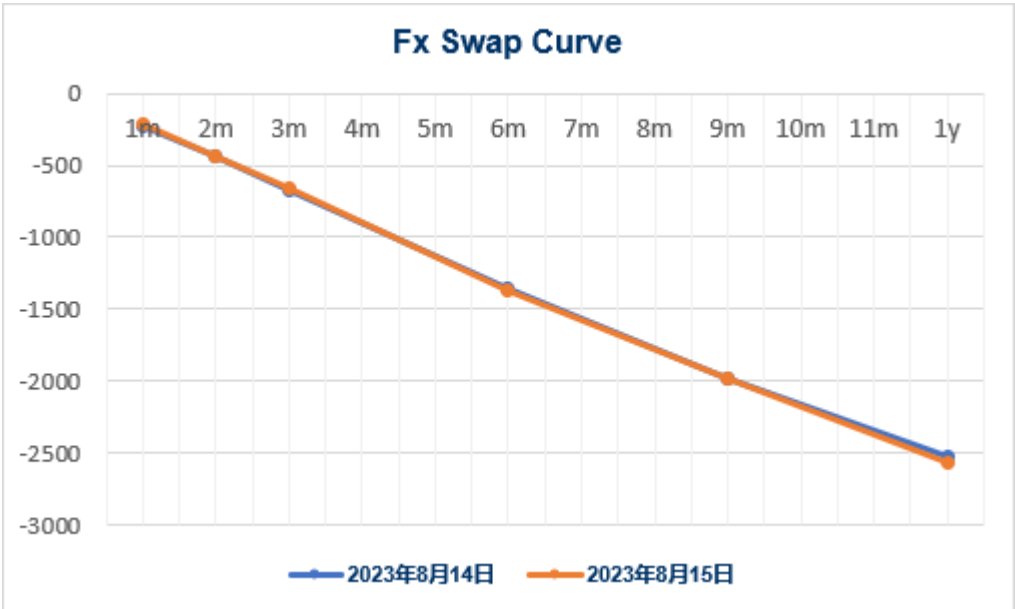
中长期限， 6s 成交在 -1388， -1382， -1379， -1377， -1375， -1368； 1y 从早上 -2650， -2630， 一路买到 -2610， -2599， -2600， 下午从 -2595， -2585， -2580， 后面收在 -2571， -2570 附近。

超长期限， 3y 成交在 -4950， -4920。

Spread 方面， 1w*2w 成交在 -48； 2w*2s 成交在 -345； 3s*6s 成交在 -706； 6s*9s 成交在 -612； 6s*1y 成交在 -1207~-1200。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	7.2824	2.5
2W	14	-93	7.2776	4
1M	32	-217	7.2651	15
2M	61	-433	7.2435	8
3M	92	-665	7.2203	13
6M	187	-1368	7.1500	-10
9M	274	-1983	7.0885	-3
1Y	368	-2568	7.0300	-37
18M	551	-3480	6.9388	-30
2Y	732	-4060	6.8808	-85
3Y	1096	-4950	6.7918	-300
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1768	
CLOSING SPOT RATE			7.2868	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-216	-448	-1151	-1766	-2351
2M		-232	-935	-1550	-2135
3M			-703	-1318	-1903
6M				-615	-1200
9M					-585



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