



【2023-07-25】

今日美元/人民币中间价报 7.1406，较上一个交易日下调 45bp，全天掉期市场交投活跃。

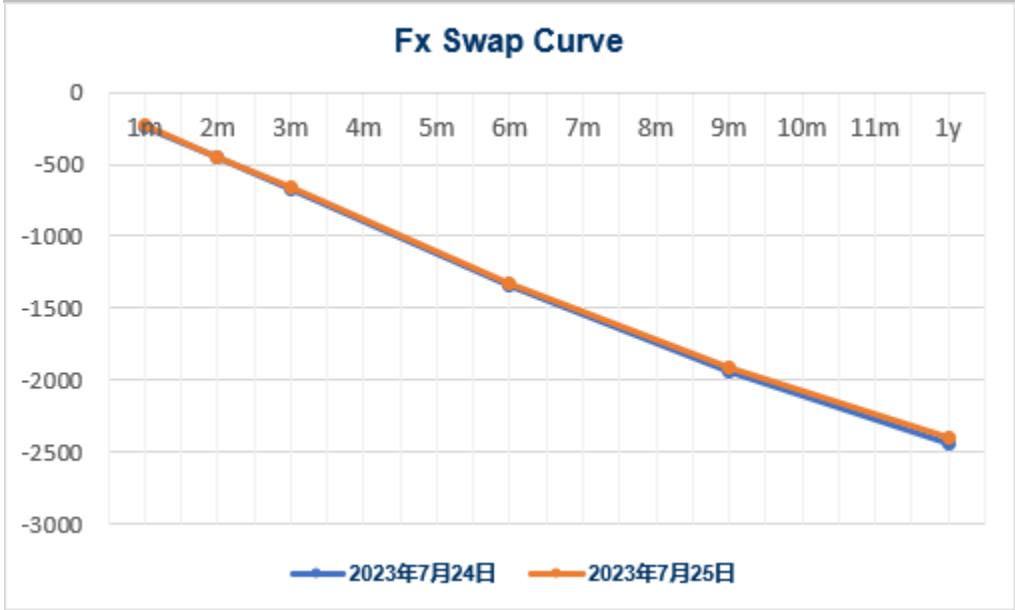
O/N 成交在-6.6~-6.1； T/N 成交在-6.3~-6.15； S/N 成交在-6.4~-6.2； 1w 成交在-46.5~-45.8； 1s 成交在-225.8~-222； 2s 成交在-444， -446； 3s 成交在-665， -664， -663。

中长期限， 6s 成交在-1325， -1324， -1322， -1328； 9s 成交在-1914； 1y 开始成交在-2410， -2395， 后面买到-2390， -2400， -2388， 最后收在-2402， 2400 附近。

Spread 方面， 3s*6s 成交在-665~-660； 3s*12s 成交在-1728； 6s*9s 成交在-586； 6s*1y 成交在-1068； 1y*3y 成交在-1993。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-46	7.1319	0.9
2W	14	-95	7.1270	4
1M	32	-226	7.1139	9
2M	62	-448	7.0917	8
3M	92	-665	7.0700	14
6M	186	-1333	7.0032	13
9M	277	-1920	6.9445	28
1Y	368	-2405	6.8960	44
18M	550	-3200	6.8165	50
2Y	732	-3675	6.7690	95
3Y	1096	-4400	6.6965	60
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1406	
CLOSING SPOT RATE			7.1365	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-222	-439	-1107	-1694	-2179
2M		-217	-885	-1472	-1957
3M			-668	-1255	-1740
6M				-587	-1072
9M					-485



文 / Edison Zeng

联系人: Rafael Wong
邮箱: rafael.wong@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:
以上所有涉及到的所有信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为给定的, 不构成任何投资建议, 其知识产权属于上海国际货币经纪有限公司 (以下简称“上海国际货币”) 或第三方。*信息*不是也不应被解释为与任何金融工具、投资策略或交易策略相关的推介、定价、建议或诱导。*信息*不可作为决策依据, 也不保证其完整性、及时性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修订。所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN