



【2023-08-29】

今日美元/人民币中间价报 7.1851，较上一个交易日下调 5bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在 -6.88~-6.8； T/N 成交在 -6.88~-6.83； S/N 成交在 -6.86~-6.68； 1w 成交在 -48.3~-47.7； 3w 成交在 -149； 1s 成交在 -200， -198.5； 2s 成交在 -436， -436.5， -435.5； 3s 成交在 -655。

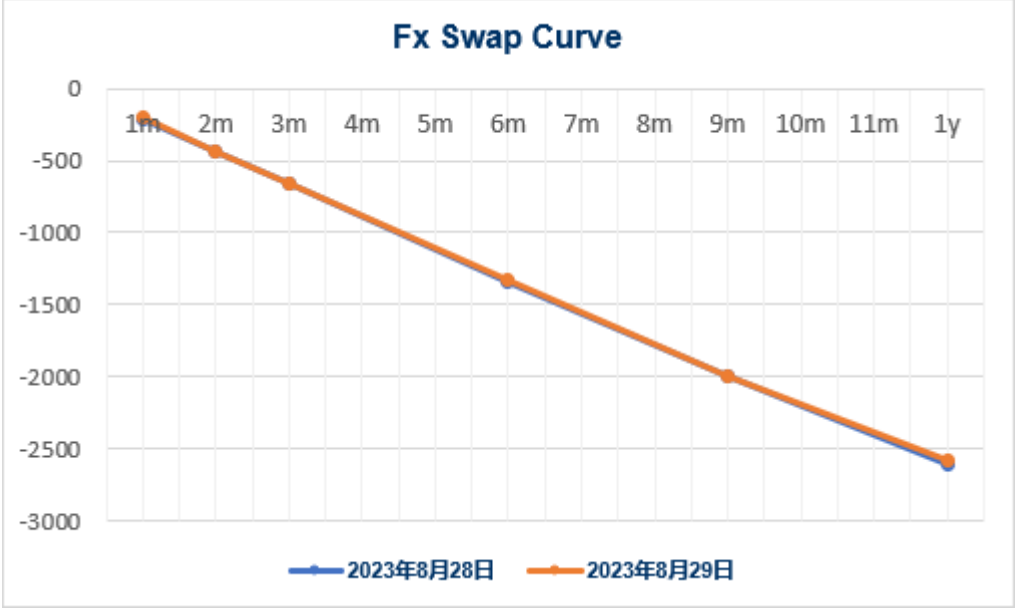
中长期限， 6s 成交在 -1328， -1326； 9s 成交在 -1985， -1984， -1982， ； 1y 成交在 -2580， -2581， -2584， -2590， -2583， 后面又给到 -2585， -2595， 最后收在 -2590 附近。

超长期限， 18s 成交在 -3510， -3505， -3500； 3y 成交在 -5240。

Spread 方面， 1w*2w 成交 -50； 2w*3w 成交在 -51； 1s*2s 成交在 -235； 2s*3s 成交在 -220； 9s*1y 成交在 -600， -598。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.2877	1
2W	14	-93	7.2832	6
1M	28	-200	7.2725	10.4
2M	61	-436	7.2489	4
3M	91	-656	7.2270	10.5
6M	182	-1330	7.1595	15
9M	274	-1991	7.0934	9
1Y	365	-2590	7.0335	17
18M	547	-3520	6.9405	90
2Y	729	-4200	6.8725	25
3Y	1096	-5200	6.7725	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1851	
CLOSING SPOT RATE			7.2925	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-236.4	-455.9	-1130.4	-1791.4	-2390.4
2M		-219.5	-894	-1555	-2154
3M			-674.5	-1335.5	-1934.5
6M				-661	-1260
9M					-599



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