



【2023-08-02】

今日美元/人民币中间价报 7.1368，较上一个交易日上调 85bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 早盘成交在在-7.1~-7 之间，午后给到-7.5；TN 从-7.41 一路买到-7.35，午后给回-7.5；SN 从-22 给到-22.3。1W 成交在-52.2~-51.95 之间，尾盘收在-52.1 附近；2W 成交在-103.5 附近。1S 成交-237.1~-237 之间；2S 成交在-494~-493 之间；3S 在-698~-695 之间来回成交，尾盘收在-696 附近。

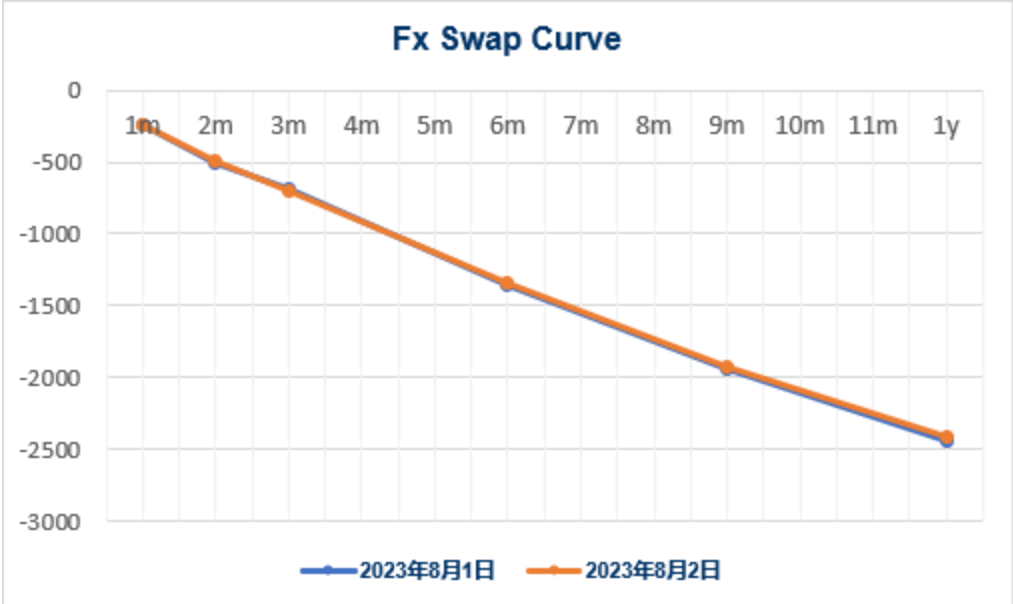
中长期限，6S 成交在-1345~-1339 之间，尾盘收在-1340 附近；9S 成交在-1930~-1926 附近；1Y 成交在-2430~-2420 之间，尾盘收在-2420 附近。

超长期限，3Y 成交在-4450。

Spread 方面，1*2S 成交在-256、-255.8，3*6S 成交在-647、-644，3*12S 成交在-1731、-1728，6*12S 成交在-1088、-1087，9*12S 成交在-494。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.1740	0.3
2W	14	-104	7.1689	1
1M	32	-238	7.1555	6.5
2M	67	-493	7.1299	9
3M	94	-695	7.1097	-9
6M	185	-1339	7.0453	18
9M	276	-1928	6.9864	11
1Y	367	-2416	6.9376	24
18M	550	-3180	6.8612	5
2Y	731	-3700	6.8092	40
3Y	1096	-4450	6.7342	30
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1368	
CLOSING SPOT RATE			7.1792	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-255.5	-457.5	-1101.5	-1690.5	-2178.5
2M		-202	-846	-1435	-1923
3M			-644	-1233	-1721
6M				-589	-1077
9M					-488



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