



【2023-08-30】

今日美元/人民币中间价报 7.1816，较上一个交易日下调 35bp，各期限收盘价较上一交易日基本持平。

ON 成交在-6.7~-6.5 之间； TN 在-6.7~-6.6 之间来回成交，尾盘收在-6.7； SN 在-27.3~-27.1 之间来回成交，午后买到过-27.03，尾盘收在-27.1 附近。1W 从-47.8 买到-47.5； 2W 成交在-98 附近； 3W 成交在-146 附近。1S 成交在-273~269 附近，尾盘收在-270； 2S 成交在-435~-434 之间； 3S 成交在-654~-653 之间，尾盘收在-653。

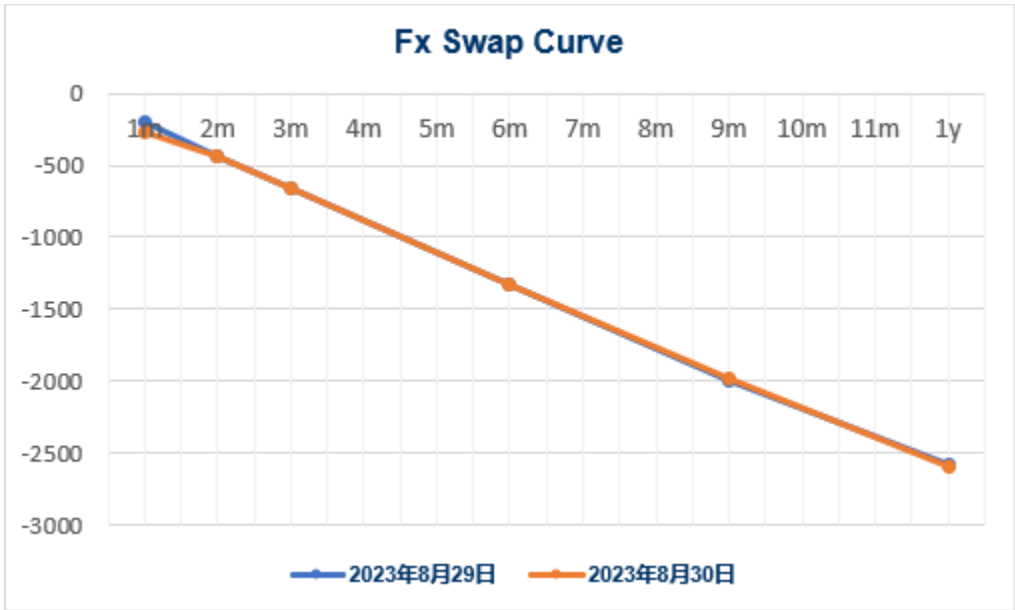
中长期限，6S 成交在-1320~-1314 之间； 9S 成交在-1990~-1965 附近； 1Y 在-2585~-2575 之间来回成交，尾盘一路给到-2595。

超长期限，2Y 成交在-4175。

Spread 方面，1*2S 成交在-162，2*3S 成交在-220~-221，3*6S 成交在-666，6*12S 成交在-1264、-1266、-1268。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-47	7.2878	0.4
2W	14	-98	7.2827	-5
1M	39	-269	7.2656	-69.4
2M	61	-432	7.2493	4
3M	91	-653	7.2272	2.5
6M	182	-1323	7.1602	7
9M	276	-1988	7.0937	3
1Y	368	-2594	7.0331	-4
18M	549	-3500	6.9425	20
2Y	732	-4185	6.8740	15
3Y	1096	-5100	6.7825	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1816	
CLOSING SPOT RATE			7.2925	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-163	-384	-1054	-1719	-2325
2M		-221	-891	-1556	-2162
3M			-670	-1335	-1941
6M				-665	-1271
9M					-606



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：
以上所登及附加的所有信息（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推介、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。