



【2023-08-23】

今日美元/人民币中间价报 7.1988，较上一个交易日下调 4bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

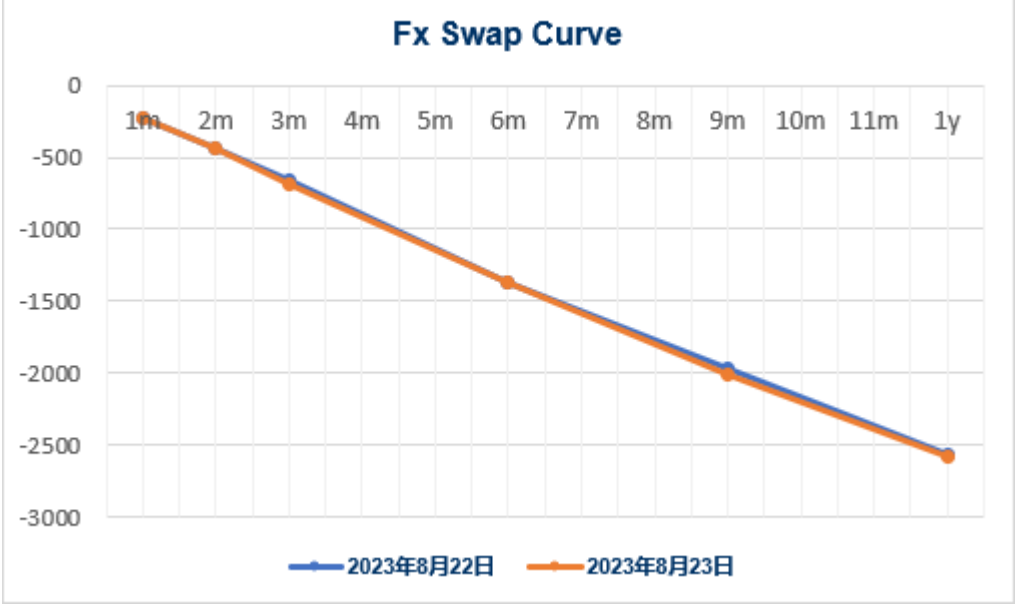
ON 成交在-7.25； TN 从开盘-6.93 一路给到-7.48； SN 早盘在-21.14~-20.85 之间来回成交，午后给到-21.4、-22。1W 成交在-49.5~-48.5 之间；2W 成交在-98.5 附近。1S 从-225 买到-221.9，尾盘收回-225 附近；2S 成交在-440；3S 从-685 买到-681，尾盘收回-684 附近；5S 成交在-1129~-1126 之间。

中长期限，6S 从-1366 买到-1361、-1360，午后在-1368~-1363 之间来回成交，尾盘收在-1365 附近；9S 成交在-2019.5~-1990 附近；1Y 从-2600 买到-2582，后给到-2584、-2585、-2590。

Spread 方面，2W*1S 成交在-123.5，3*6S 成交在-683， 6*9S 成交在-642， 6*12S 成交在-1222、-1223、-1227、-1230， 9*12S 成交在-586、-581。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2874	-2.7
2W	14	-100	7.2824	-6
1M	31	-225	7.2698	-0.5
2M	61	-442	7.2481	-6
3M	94	-684	7.2239	-24
6M	185	-1364	7.1559	1
9M	277	-2011	7.0913	-40.5
1Y	367	-2590	7.0333	-25
18M	550	-3600	6.9323	-175
2Y	731	-4100	6.8823	100
3Y	1096	-5200	6.7723	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1988	
CLOSING SPOT RATE			7.2923	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-217	-459	-1139	-1785.5	-2365
2M		-242	-922	-1568.5	-2148
3M			-680	-1326.5	-1906
6M				-646.5	-1226
9M					-579.5



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, 且为保密的利/读者专用的信息, 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、投资项任何交易策略相关的推介、出价、建议或需求。“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