



【2023-07-19】

今日美元/人民币中间价报 7.1486，较上一个交易日上调 33bp，各期限收盘价较上一交易日略微上行。

ON 从-6.35 买到-6； TN 早盘成交在-6.85~-6.6 之间，尾盘买到-6.2 附近； SN 从-20.5 买到-19.7，尾盘收在-19.9 附近。1W 在从-47.8 买到-47； 2W 成交在-98 附近。1S 成交在-225~-224.5 之间； 2S 成交在-459.5~-456 附近； 3S 成交在-697~-693 之间，尾盘收在-697。

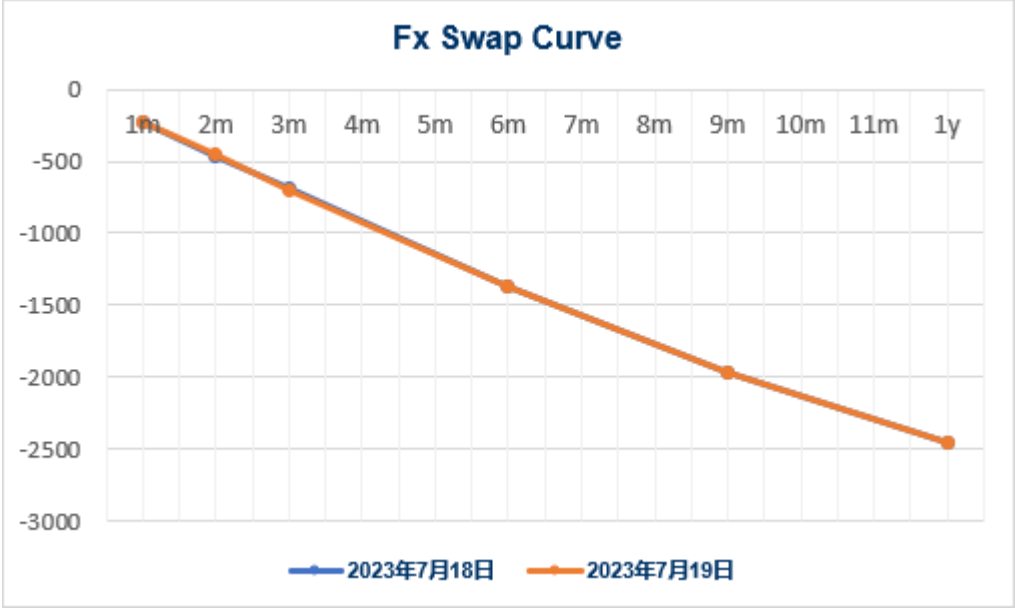
中长期， 6S 成交在-1366~-1365 之间； 9S 成交在-1974~-1972 之间； 1Y 成交在-2461~-2455 之间，尾盘收在-2459。

超长期限， 3Y 成交在-4400。

Spread 方面， 6*12S 成交在-1088， 9*12S 成交在-491， 1*2Y 成交在-1260、-1275， 1*3Y 成交在-1975， 2*3Y 成交在-700。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.2150	1.1
2W	14	-97	7.2100	2
1M	31	-225	7.1972	7.3
2M	62	-457	7.1740	1
3M	94	-697	7.1500	-5
6M	185	-1370	7.0827	7
9M	276	-1968	7.0229	2
1Y	367	-2461	6.9736	-3
18M	550	-3150	6.9047	100
2Y	731	-3700	6.8497	50
3Y	1096	-4375	6.7822	75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1486	
CLOSING SPOT RATE			7.2197	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-231.8	-471.8	-1144.8	-1742.8	-2235.8
2M		-240	-913	-1511	-2004
3M			-673	-1271	-1764
6M				-598	-1091
9M					-493



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