



【2023-08-16】

今日美元/人民币中间价报 7.1986，较上一个交易日上调 218bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

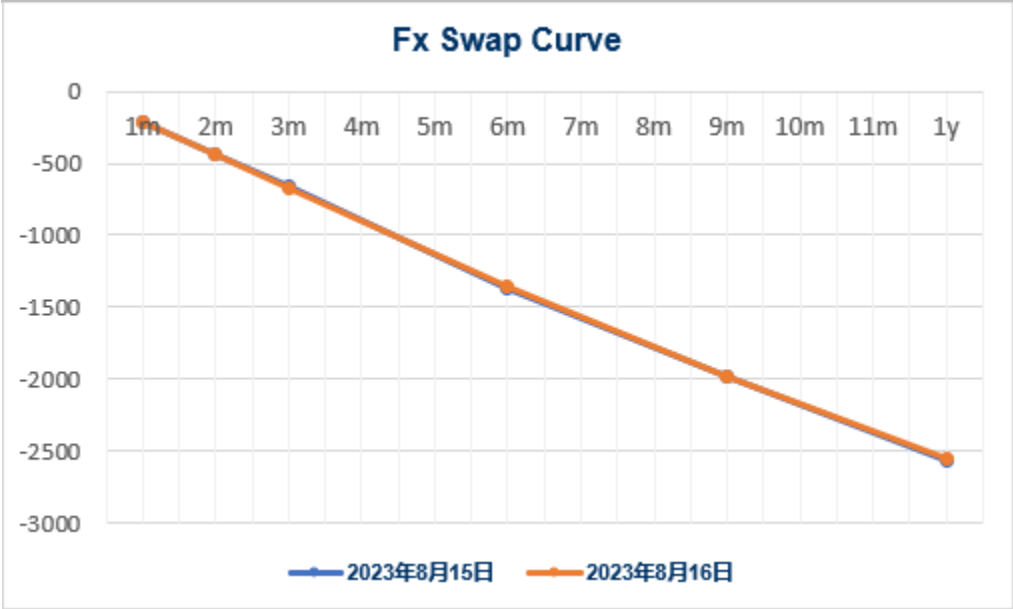
ON 成交在-6.2~-5.8 之间；TN 早盘在-5.9~-5.2 之间来回成交，午后一路给到-6.25；SN 在-17~-16.2 之间来回成交。1W 早盘成交在-42~-41 之间，午后给到过-42.4、-42.7、-43.5、-44；2W 成交在-90.5~-89.5 之间。1S 成交在-213~-206.3 之间；2S 从-423 给到-425；3S 早盘成交在-673~-665 之间，午后从-669 给到-675，尾盘收在-675；5S 从-1110 给到-1117。

中长期限，6S 成交在-1358~-1344.5 之间；9S 从-1963 给到-1990，尾盘收在-1990；1Y 早盘在-2530~-2540 之间来回成交，尾盘一路给到-2563。

Spread 方面，1*2S 成交在-216，3*12S 成交在-1862、-1865，5*6S 成交在-236，6*9S 成交在-620，9*12S 成交在-566、-567、-569、-573。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	7.2860	0
2W	14	-90	7.2814	3
1M	31	-216	7.2688	1
2M	61	-430	7.2474	3
3M	94	-676	7.2228	-11
6M	186	-1355	7.1549	13
9M	276	-1985	7.0919	-2
1Y	367	-2555	7.0349	13
18M	550	-3510	6.9394	-30
2Y	731	-4075	6.8829	-15
3Y	1096	-5100	6.7804	-150
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1986	
CLOSING SPOT RATE			7.2904	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-214	-460	-1139	-1769	-2339
2M		-246	-925	-1555	-2125
3M			-679	-1309	-1879
6M				-630	-1200
9M					-570



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