



【2023-08-04】

今日 Fixing 定在 7.1418，较上一交易日下调了 77 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅下跌。

短端，O/N 成交在-22.6~-21。T/N 成交-7.7~-7.55。S/N 成交在-7.65~-7.55。1w 成交在-53.8~-53。2w 成交在-105.5。1s 成交在-236~-234。2s 成交在-482~-480。3s 成交在-707~-701，尾盘收在-701。

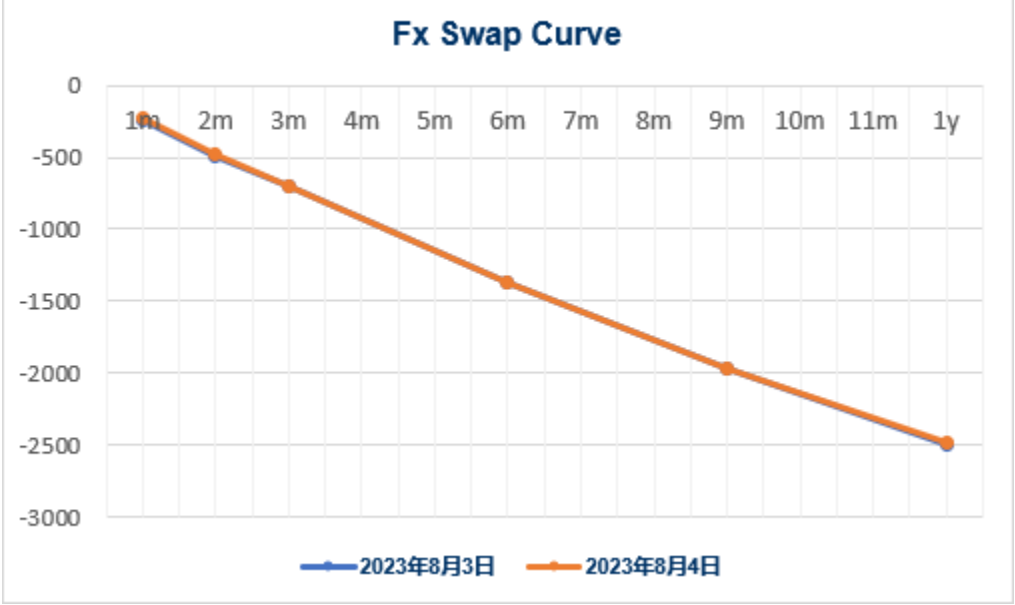
中长期限，6s 成交在-1379~-1370，尾盘收在-1373。9s 成交在-1973。1y 成交在-2505~-2490，尾盘收在-2491。

长期限上，3y 成交在-4610。

Spread 上，2w*1s 成交在-128.5。2*3s 成交在-222。3*6s 成交在-671。1*2y 成交在-1370。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.1750	1.85
2W	14	-105	7.1697	1
1M	31	-234	7.1568	2.8
2M	63	-480	7.1322	8
3M	92	-701	7.1101	4
6M	184	-1373	7.0429	1
9M	274	-1971	6.9831	4
1Y	366	-2490	6.9312	5
18M	552	-3325	6.8477	-25
2Y	731	-3830	6.7972	50
3Y	1098	-4650	6.7152	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1418	
CLOSING SPOT RATE			7.1802	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-246	-467	-1139	-1737	-2256
2M		-221	-893	-1491	-2010
3M			-672	-1270	-1789
6M				-598	-1117
9M					-519



文 / Jason Ge

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。