



【2023-08-25】

今日 Fixing 定在 7.1883，较上一交易日下调了 3 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅下跌。

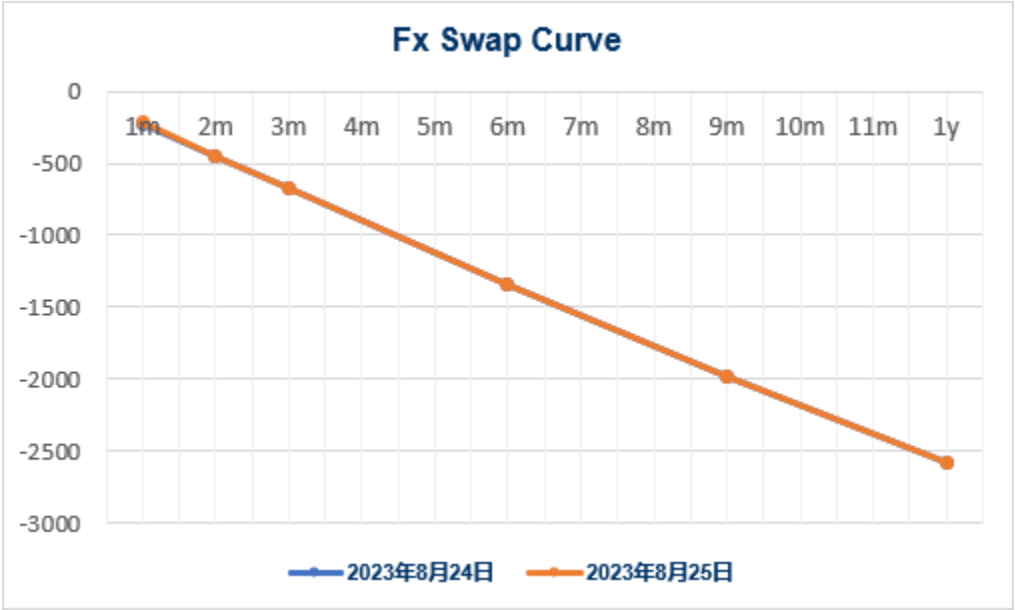
短端，O/N 成交在-23~-21.5。T/N 成交-7.58~-7.3。S/N 成交在-7.35~-7.2。1w 成交在-50.5~-49.9。2w 成交在-101~-99.9。1s 成交在-219.2~-218.5。2s 成交在-448.5~-447。3s 成交在-672~-668，尾盘收在-670。。

中长期限，4s 成交在-890，-888。5s 成交在-1120。6s 成交在-1350~-1345，尾盘收在-1348。9s 成交在-1986~-1980。1y 成交在-2590~-2580，尾盘收在-2583。

Spread 上，1w*2w 成交在-50。2w*1s 成交在-118。1*2s 成交在-229。2*3s 成交在-222。9*12s 成交在-600，-599。6*12s 成交在-1238，-1239。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2834	7.2
2W	14	-100	7.2784	0
1M	30	-219	7.2665	6.1
2M	62	-448	7.2436	7
3M	92	-670	7.2214	-1
6M	184	-1348	7.1536	0
9M	274	-1985	7.0899	0
1Y	366	-2581	7.0303	-3
18M	549	-3600	6.9284	0
2Y	731	-4225	6.8659	-25
3Y	1098	-5200	6.7684	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1883	
CLOSING SPOT RATE			7.2884	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-229.1	-451.1	-1129.1	-1766.1	-2362.1
2M		-222	-900	-1537	-2133
3M			-678	-1315	-1911
6M				-637	-1233
9M					-596



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