



【2023-08-28】

今日 Fixing 定在 7.1856 ，较上一交易日下调了 27 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下降。

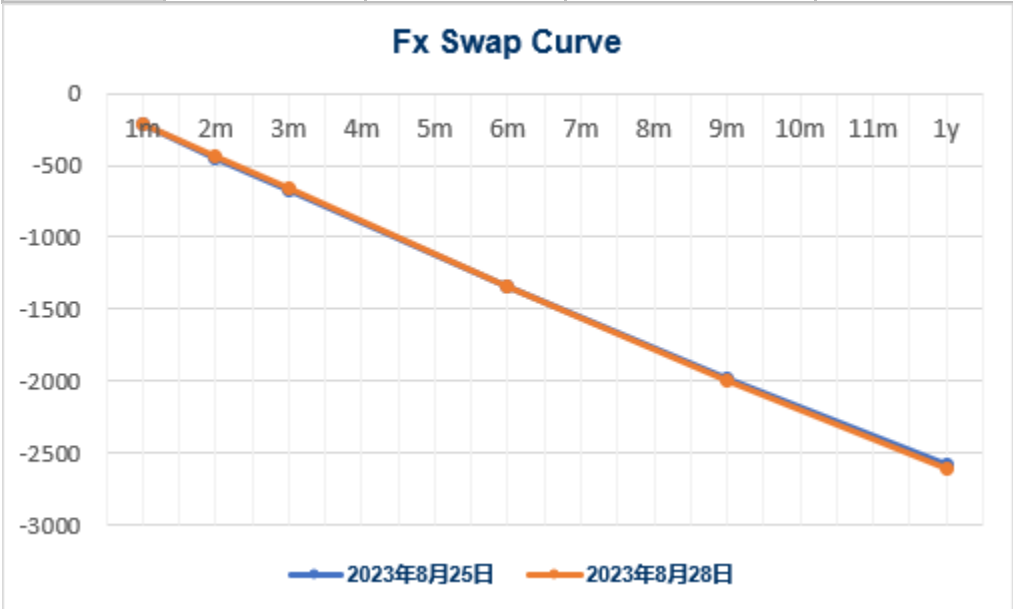
短端，O/N 成交在 -7~-6.7 ，T/N 成交在 -7.1~-6.75 ，S/N 成交在 -7.2~-6.84 。1w 反复成交在 -49, -48.8, -48.6 的位置；2w 成交在-99 的位置；1s 成交在 -211, -210, -209 的位置；2s 成交在 -440, -439, -438 的位置；3s 成交在 -666, -665, -664, -663, -662 的位置；

中长期限，6s 成交在 -1349, -1345, -1340, -1335 的位置；9s 成交在 -1998, -1995, -1992, -1988, -1985, -1980 的位置；1y 反复成交在 -2614, -2610, -2605, -2600, -2590, -2585, -2580, -2575, -2570 的位置。

Spread 上，1s*2s 成交在 -228 的位置；2s*3s 成交在-226.5 的位置；3s*6s 成交在-680, -679 的位置；9s*1y 成交在-604, -600 的位置；

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.2891	1.5
2W	14	-99	7.2841	1
1M	29	-210	7.2730	8.9
2M	61	-440	7.2500	8
3M	92	-666	7.2274	4
6M	183	-1345	7.1595	3
9M	274	-2000	7.0940	-15
1Y	366	-2607	7.0333	-26
18M	548	-3610	6.9330	-10
2Y	730	-4225	6.8715	0
3Y	1097	-5200	6.7740	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1856	
CLOSING SPOT RATE			7.2940	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-230	-456	-1135	-1790	-2397
2M		-226	-905	-1560	-2167
3M			-679	-1334	-1941
6M				-655	-1262
9M					-607



文 / Ray Yan

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