



【2023-08-21】

今日 Fixing 定在 7.1987 ，较上一交易日下调了 19 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 -6.85~-6 ，T/N 成交在 -6.9~-6.25 ，S/N 成交在 -6.8~-6.48 。1w 反复成交在 -47.2,-47.1,-47,-46.8,-46.5 的位置；2w 成交在-95 的位置；

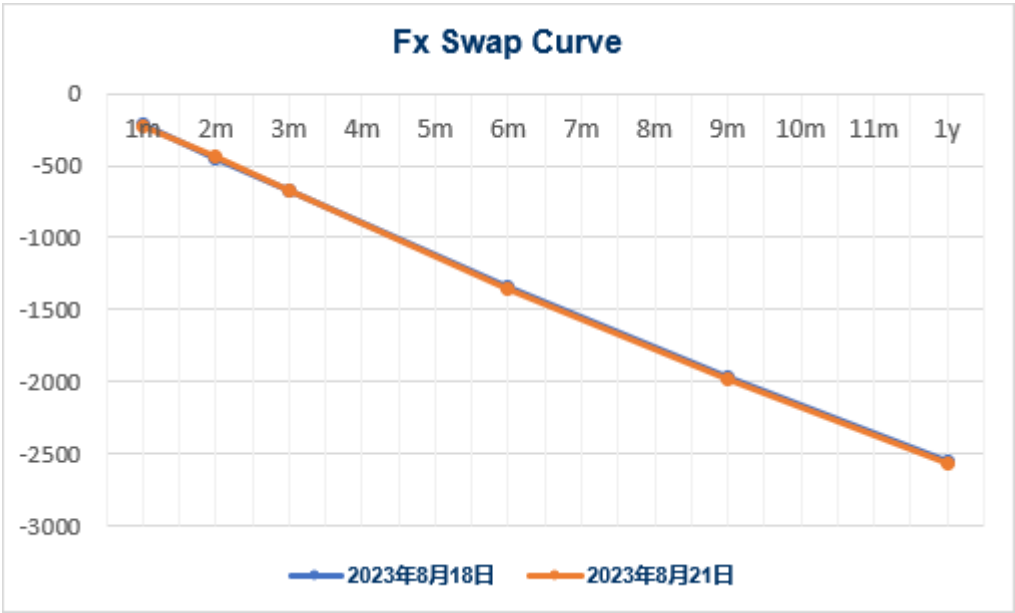
1s 成交在 -233.5,-233,-232.8,-232.5,-232,-231 的位置；2s 成交在 -439,-438,-437,-435 的位置；3s 成交在 -681,-680.5,-679.5,-678,-677,-676,-673,-670 的位置；

中长期，6s 成交在 -1360,-1359,-1358,-1356,-1355,-1352,-1351,-1350,-1348 的位置；9s 成交在 -1990,-1987.5,-1983,-1982,-1980 的位置；1y 反复成交在 -2575,-2574,-2573,-2572,-2571,-2570,-2569,-2562,-2560 的位置。

Spread 上，1s*3s 成交在 -448 的位置；6s*9s 成交在-631,-630 的位置；6s*1y 成交在-1215 的位置；

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-47	7.3092	-0.46
2W	14	-95	7.3045	-1
1M	33	-229	7.2910	-10
2M	61	-434	7.2705	10
3M	93	-675	7.2464	-4.5
6M	184	-1354	7.1785	-6
9M	274	-1985	7.1154	-10
1Y	366	-2570	7.0569	-20
18M	551	-3515	6.9624	-90
2Y	733	-4200	6.8939	-110
3Y	1097	-5100	6.8039	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1987	
CLOSING SPOT RATE			7.3139	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-205	-446	-1125	-1756	-2341
2M		-241	-920	-1551	-2136
3M			-679	-1310	-1895
6M				-631	-1216
9M					-585



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