



【2023-08-14】

今日 Fixing 定在 7.1686 ，较上一交易日上调了 99 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 -6.55~-6.20 ，T/N 成交在 -6.80~-6.25 ，S/N 成交在 -6.78~-6.45 。1w 反复成交在 -47.9,-47.2, -47,-46.8,-46.5,-46.4 的位置；

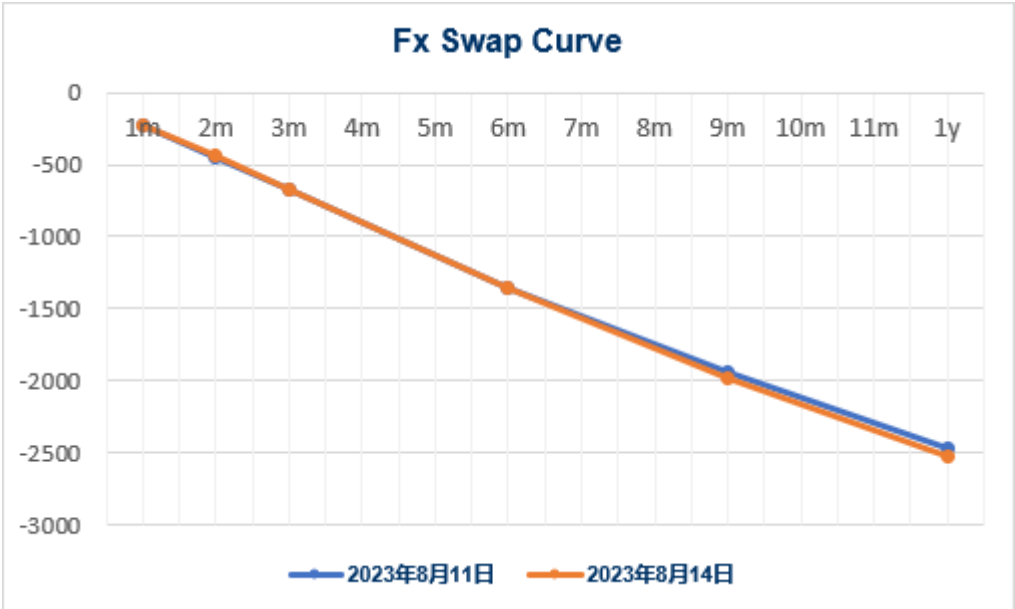
1s 成交在 -233,-232.5,-232 的位置；2s 成交在 -447,-446,-445 的位置；3s 成交在 -684,-683,-682,-681,-680,-679 的位置；

中长期，6s 成交在 -1370,-1368.5,-1368,-1367,-1366,-1365,-1363,-1362,-1360 的位置；9s 成交在 -1987,-1986,-1985,-1983,-1980,-1978,-1973 的位置；1y 反复成交在 -2548,-2545,-2542,-2541,-2540,-2538,-2535,-2532,2530,-2525 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -50.2 的位置；2w*2s 成交在 -345 的位置；3s*6s 成交在-686,-683,-681,-680 的位置;9s*1y 成交在-550 的位置；

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-46	7.2491	2
2W	14	-97	7.2441	2
1M	33	-232	7.2305	-9
2M	61	-441	7.2096	12
3M	92	-678	7.1859	1
6M	184	-1359	7.1179	-5
9M	274	-1980	7.0557	-43
1Y	366	-2531	7.0006	-58
18M	552	-3450	6.9087	-125
2Y	733	-3975	6.8562	-130
3Y	1097	-4650	6.7887	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1686	
CLOSING SPOT RATE			7.2537	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-209	-446	-1126.5	-1748	-2299
2M		-237	-917.5	-1539	-2090
3M			-680.5	-1302	-1853
6M				-621.5	-1172.5
9M					-551



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