



【2023-08-07】

今日 Fixing 定在 7.1380，较上一交易日下调了 38 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~-5.5，T/N 成交在 -7.11~-6.3，S/N 成交在 -7.2~-6.93。1w 反复成交在 -50.5, -50.3, -50.2, -50, -49.8, -49.5 的位置；2w 成交在 -102, -101.5 的位置；

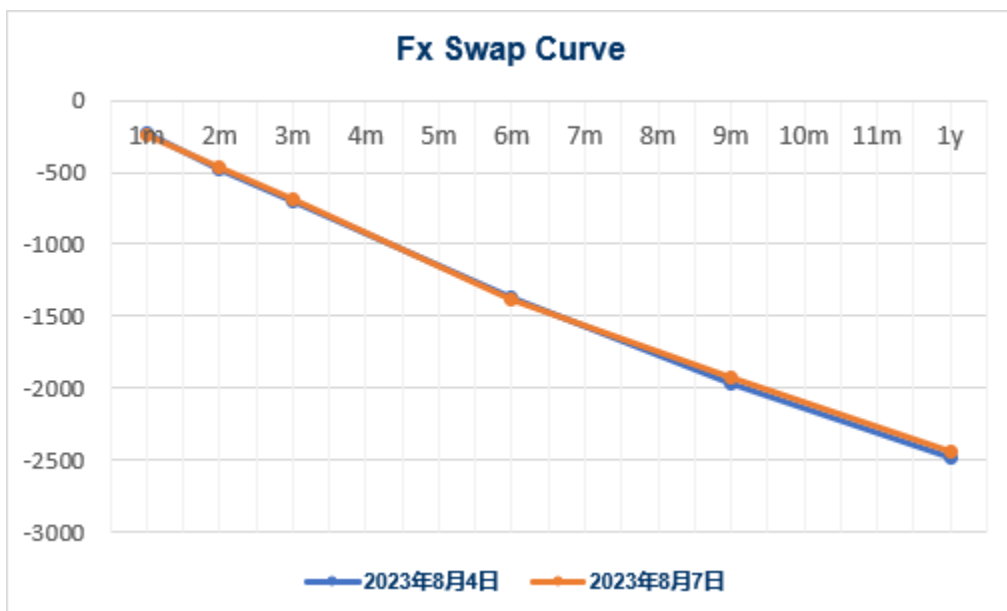
1s 成交在 -245, -243, -242, -241 的位置；2s 成交在 -459, -458 的位置；3s 成交在 -691, -690, -689, -688, -687, -686.5, -686, -685 的位置；

中长期限，6s 成交在 -1392, -1391, -1390, -1389, -1387, -1386 的位置；9s 成交在 -1938, -1937, -1934 的位置；1y 反复成交在 -2457, -2455, -2454, -2451, -2450, -2449, -2448, -2447, -2445, -2444, -2442, -2441, -2440 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -705, -702 6s*9s 成交在 -547 的位置；6s*1y 成交在 -1057, -1055 的位置，9s*1y 成交在 -514, -512 的位置；

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.1870	2.4
2W	14	-102	7.1818	3
1M	33	-241	7.1679	-7
2M	62	-460	7.1460	20
3M	92	-684	7.1236	17
6M	191	-1390	7.0530	-17
9M	274	-1933	6.9987	38
1Y	366	-2446	6.9474	44
18M	551	-3350	6.8570	-25
2Y	733	-3760	6.8160	70
3Y	1097	-4500	6.7420	150
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1380	
CLOSING SPOT RATE			7.1920	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-219	-443	-1149	-1692	-2205
2M		-224	-930	-1473	-1986
3M			-706	-1249	-1762
6M				-543	-1056
9M					-513



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报及更多资讯



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