



【2023-08-09】

今日 Fixing 定在 7.1588，较上一交易日上升了 23 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所下降。

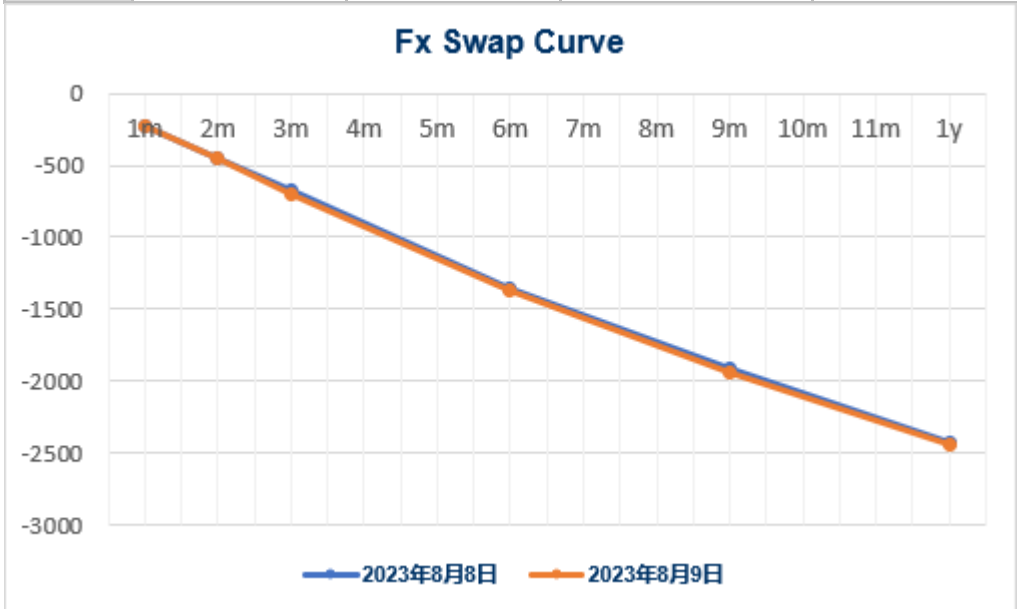
短端，O/N 主要成交在-7.4~-5.5。T/N 主要成交在-7~-6.1 的位置。S/N 主要成交在-20~-18.3 的位置。1w 成交在-45，-46，-46.5，-47.2，-47 等位置。2w 成交在-97 的位置。1s 成交在-220，-220.5，-221，-222，-223，-224 等位置。2s 成交在-443，-442，-444，-445，-446 的位置。3s 成交在-685，-687，-688，-690，-692，-693，-694，-695，-696 的位置。

中长期限，6s 成交在-1355，-1360，-1362，-1365，-1368，-1369，-1370 等位置。9s 成交在-1920，-1925，-1927.5，-1930，-1933.5 等位置。1y 成交在-2415，-2420，-2425，-2424，-2427，-2432，-2435，-2440，-2445 等位置。

Spread 方面，2*3s 成交在-250 的位置。3*6s 成交在-668，-669，-670，-673 等位置。6*9s 成交在-563，-562 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-47	7.1942	0.1
2W	14	-98	7.1891	-2
1M	31	-225	7.1765	4.5
2M	61	-445	7.1544	0
3M	94	-695	7.1294	-20
6M	189	-1372	7.0617	-12
9M	276	-1935	7.0054	-23
1Y	367	-2445	6.9544	-10
18M	550	-3300	6.8689	-100
2Y	731	-3740	6.8249	-10
3Y	1096	-4500	6.7489	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1588	
CLOSING SPOT RATE			7.1989	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-220.5	-470.5	-1147.5	-1710.5	-2220.5
2M		-250	-927	-1490	-2000
3M			-677	-1240	-1750
6M				-563	-1073
9M					-510



文 / Yiff Wang

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。