



【2023-08-17】

今日 Fixing 定在 7.2076，较上一交易日上升了 90 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~-6.5。T/N 主要成交在-20.7~-18.2 的位置。S/N 主要成交在-6.75~-6.65 的位置。1w 成交在-47.5，-47.4，-47.3 等位置。2w 成交在-102，-103 的位置。1s 成交在-220，-220.5 位置。2s 成交在-460，-457，-455 的位置。3s 成交在-680，-679，-678，-676，-675，-674，-673，-672，-675，-676 的位置。4s 成交在-905，-901 的位置。5s 成交在-1148，-1145，-1140，-1138 的位置。

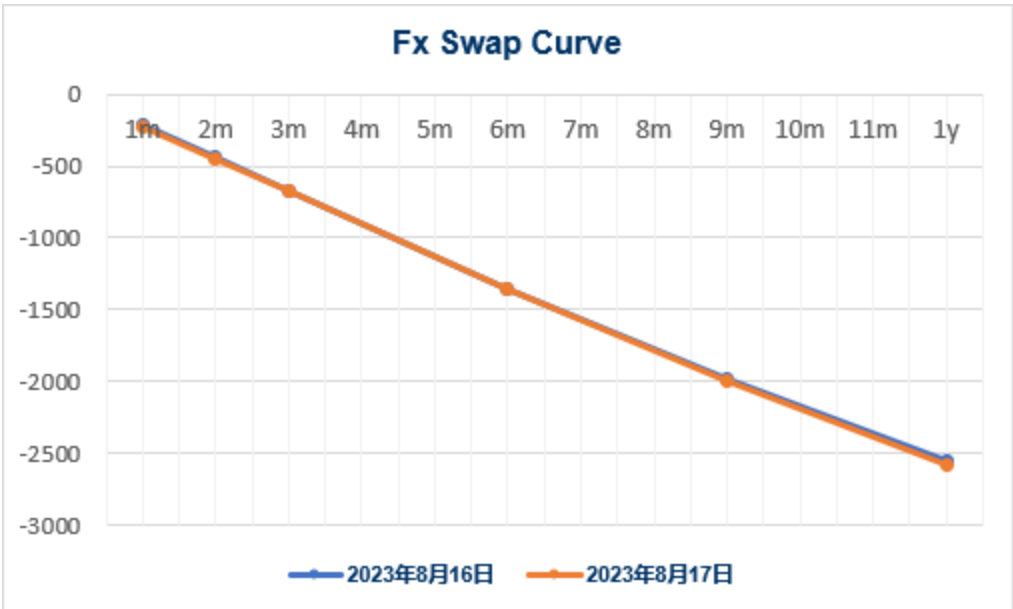
中长期限，6s 成交在-1365，-1362，-1360，-1358，-1355，-1357 等位置。9s 成交在-1995，-2000，-1997，-1990 等位置。1y 成交在-2595，-2600，-2590，-2588，-2585，-2582，-2580，-2577，-2582 等位置。

超长方面，2y 成交在-4200 的位置。

Spread 方面，1w*2w 成交在-55.5 的位置。2*3s 成交在-222 的位置。6*12s 成交在-1230 的位置。4*5s 成交在-232 的位置。5*6s 成交在-220 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-47	7.3056	-3.6
2W	15	-105	7.2998	-15
1M	31	-221	7.2883	-4.5
2M	63	-454	7.2649	-24
3M	92	-676	7.2427	0
6M	184	-1356	7.1747	-1
9M	274	-1991	7.1112	-6
1Y	366	-2582	7.0521	-27
18M	550	-3500	6.9603	10
2Y	731	-4200	6.8903	-125
3Y	1096	-5150	6.7953	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.2076	
CLOSING SPOT RATE			7.3103	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-233.5	-455.5	-1135.5	-1770.5	-2361.5
2M		-222	-902	-1537	-2128
3M			-680	-1315	-1906
6M				-635	-1226
9M					-591



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。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN