



【2023-08-18】

今日 Fixing 定在 7.2006，较上一交易日下调了 70 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上升。

短端，O/N 成交在-19~-18.5。T/N 成交-6.7~-6.3。S/N 成交在 -6.6~-6.4。1w 成交在-46.7~-45.9。2w 成交在-94。1s 成交在-220~-218。2s 成交在-445~-444。3s 成交在-672~-666，尾盘收在-671。

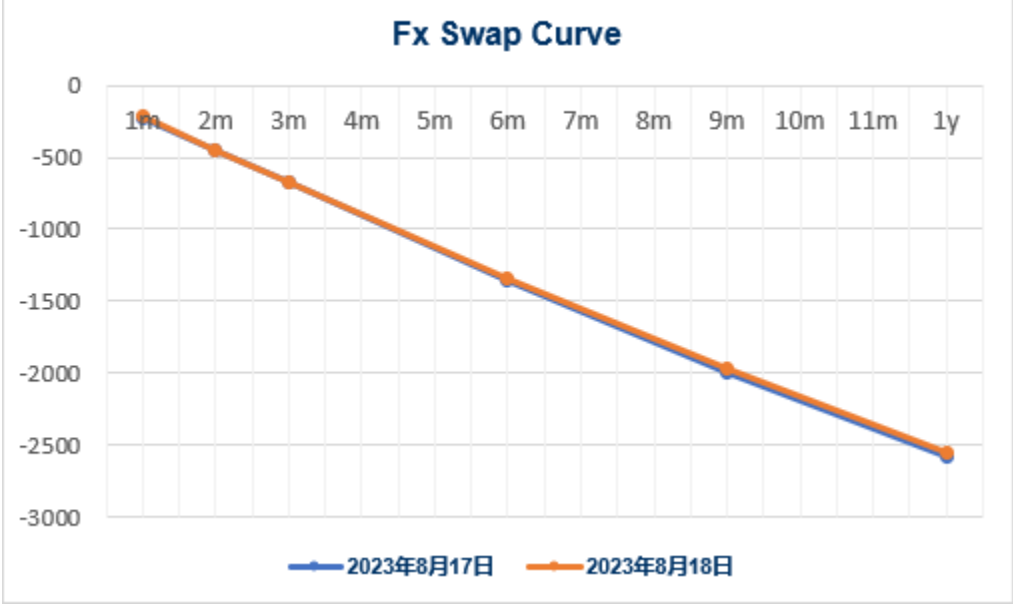
中长期限，5s 成交在-1125。6s 成交在-1353~-1345，尾盘收在-1348。9s 成交在-1980~-1970。1y 成交在-2555~-2540，尾盘收在-2555。

长期限上，2y 成交在-4130。

Spread 上，1w*2w 成交在-48，-47.8。1*2s 成交在-225.5。2*3s 成交在-226.5。5*6s 成交在-228。9*12s 成交在-576~-575。6*12s 成交在-1202。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-46	7.2850	1.2
2W	14	-94	7.2802	11
1M	31	-219	7.2677	1.5
2M	62	-444	7.2452	10
3M	92	-671	7.2226	5.5
6M	184	-1348	7.1548	8
9M	274	-1975	7.0921	16
1Y	366	-2550	7.0346	32
18M	552	-3425	6.9471	75
2Y	731	-4090	6.8806	110
3Y	1098	-5050	6.7846	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.2006	
CLOSING SPOT RATE			7.2896	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-225	-451.5	-1129	-1756	-2331
2M		-226.5	-904	-1531	-2106
3M			-677.5	-1304.5	-1879.5
6M				-627	-1202
9M					-575



文 / Jason Ge

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。