



【2023-08-03】

今日 Fixing 定在 7.1495，较上一交易日上升了 127 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所下降。

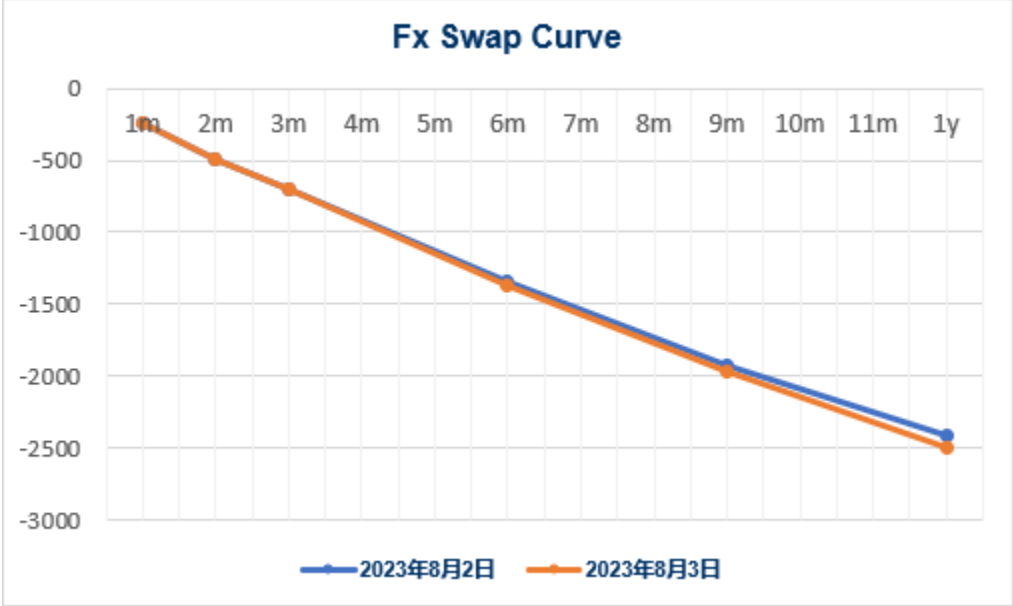
短端，O/N 主要成交在-8.7~-7.7。T/N 主要成交在-22.98~-22.5 的位置。S/N 主要成交在-7.76~-7.72 的位置。1w 成交在-53.5， -53.7， -53.8， -53.84， -53.9， -53.7， -53.85 等位置。2w 成交在-106， -106.4 的位置。3w 成交在-159.5， -159.3 的位置。1s 成交在-233， -233.5， -234， -235， -236， -236.8 位置。2s 成交在-481， -481.5， -483， -485， -488 的位置。3s 成交在-690， -693， -695， -697， -698， -700， -701， -701.5， -702， -703， -704 的位置。4s 成交在-930 的位置。5s 成交在-1152， -1155， -1160 的位置。

中长期限，6s 成交在-1350， -1355， -1360， -1364， -1366， -1368， -1370， -1372， -1376 等位置。9s 成交在-1940， -1945， -1956， -1960， -1970， -1974 等位置。1y 成交在-2430， -2440， -2445， -2448， -2450， -2465， -2475， -2480， -2485， -2488 等位置。

Spread 方面，3*6s 成交在-667， -660 的位置。6*12s 成交在-1097.5 的位置。12s*18s 成交在-840。1Y*2Y 成交在-1370 的位置。1Y*3Y 成交在-2115 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-54	7.1841	-1.75
2W	14	-106	7.1789	-3
1M	31	-237	7.1658	0.7
2M	64	-488	7.1408	6
3M	92	-705	7.1190	-10
6M	184	-1374	7.0521	-35
9M	274	-1975	6.9920	-47
1Y	366	-2495	6.9400	-79
18M	550	-3300	6.8595	-120
2Y	731	-3880	6.8015	-180
3Y	1096	-4550	6.7345	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1495	
CLOSING SPOT RATE			7.1895	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-250.7	-468.2	-1137.2	-1738.2	-2258.2
2M		-217.5	-886.5	-1487.5	-2007.5
3M			-669	-1270	-1790
6M				-601	-1121
9M					-520



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