



【2023-08-24】

今日 Fixing 定在 7.1886，较上一交易日下降了 102 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-8.5~-7.5。T/N 主要成交在-23.4~-22 的位置。S/N 主要成交在-7.7~-7.25 的位置。1w 成交在-59，-58.8，-58.5，-58.2，-58，-57.5，-57.7 等位置。2w 成交在-100，-101 的位置。1s 成交在-226，-225 等位置。2s 成交在-458，-456，-455 的位置。3s 成交在-675，-673，-670，-667，-665，-668，-671，-669 的位置。

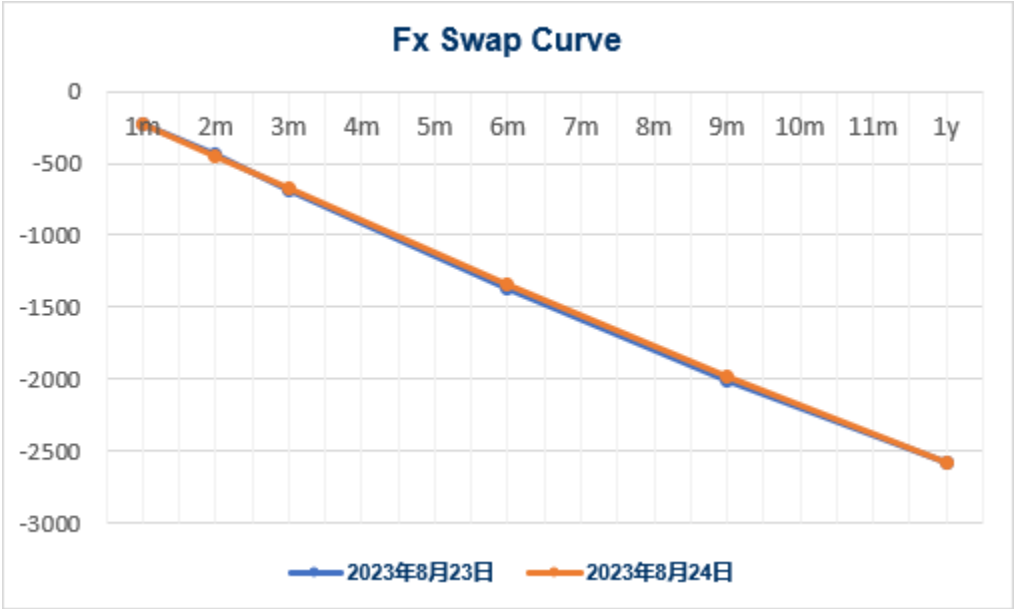
中长期限，6s 成交在-1360，-1358，-1355，-1354，-1352，-1345，-1355，-1351，-1348 等位置。9s 成交在-1992，-1990，-1988，-1985，-1980，-1975，-1978，-1984，-1988，-1981 等位置。1y 成交在-2613，-2615，-2605，-2600，-2598，-2595，-2590，-2587，-2585，-2580，-2576，-2578 等位置。

超长方面，2y 成交在-4200 的位置。

Spread 方面，1w*2w 成交在-43 的位置。1*3s 成交在-443.5 的位置。6*9s 成交在-633，-631 等位置。9*12s 成交在-601，-597 等位置。6*12s 成交在-1233，-1230，-1228 等位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-58	7.2720	-8
2W	14	-100	7.2677	-1
1M	31	-225	7.2552	0
2M	63	-455	7.2322	-13
3M	92	-669	7.2108	15
6M	184	-1348	7.1429	16
9M	274	-1985	7.0792	25.5
1Y	366	-2578	7.0199	12
18M	550	-3600	6.9177	0
2Y	731	-4200	6.8577	-100
3Y	1096	-5200	6.7577	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1886	
CLOSING SPOT RATE			7.2777	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-230	-444	-1123	-1760	-2353
2M		-214	-893	-1530	-2123
3M			-679	-1316	-1909
6M				-637	-1230
9M					-593



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