



【2023-08-11】

今日 Fixing 定在 7.1587，较上一交易日上调了 11 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅下跌。

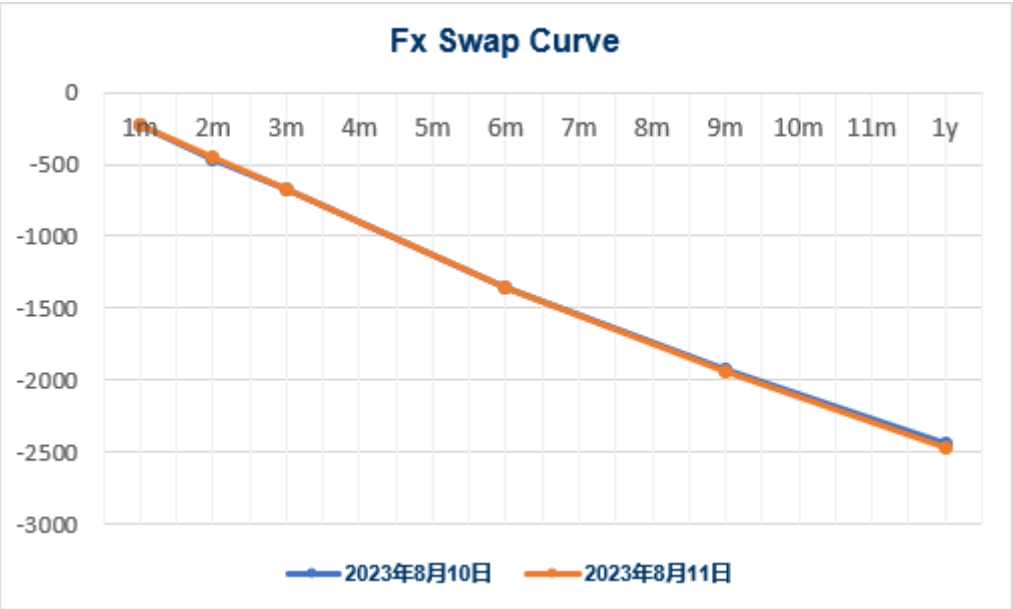
短端，O/N 成交在-20.95~-20.6。T/N 成交-7.17~-6.7。S/N 成交在-7.15~-6.85。1w 成交在-48.5~-48。2w 成交在-98。1s 成交在-224.5~-223。2s 成交在-458~-453。3s 成交在-683~-677，尾盘收在-680。

中长时间，6s 成交在-1355~-1346，尾盘收在-1355。9s 成交在-1935~-1928。1y 成交在-2470~-2445，尾盘收在-2471.5。

Spread 上，1*3s 成交在-456。3*6s 成交在-668。9*12s 成交在-523~-518。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.2292	-0.3
2W	14	-98	7.2242	2
1M	31	-223	7.2117	1
2M	62	-453	7.1887	9
3M	92	-679	7.1661	1
6M	185	-1354	7.0986	0
9M	274	-1937	7.0403	-7
1Y	366	-2473	6.9867	-28
18M	553	-3325	6.9015	-75
2Y	731	-3845	6.8495	-45
3Y	1098	-4600	6.7740	-75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1587	
CLOSING SPOT RATE			7.2340	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-230	-456	-1131	-1714	-2250
2M		-226	-901	-1484	-2020
3M			-675	-1258	-1794
6M				-583	-1119
9M					-536



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报及更多资讯



免责声明:

以上所登及附加的所有信息 (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

禁止处理涉密信息和内部敏感信息