



【2024-08-21】

今日 Fixing 定在 7.1307，较上一交易日上调了 18 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

短端，O/N 成交在 -8~-7.2 的位置；T/N 成交在 -7.9~-7.35 的位置；S/N 成交在 -22.6 ~-22.1 的位置。1w 成交在 -53.5， -53 的位置；2w 成交在 -111， -110.5， -109 的位置；3w 成交在 -165 的位置；1s 成交在 -246， -245 的位置；2s 成交在 -481 的位置；3s 成交在 -730， -725 的位置。

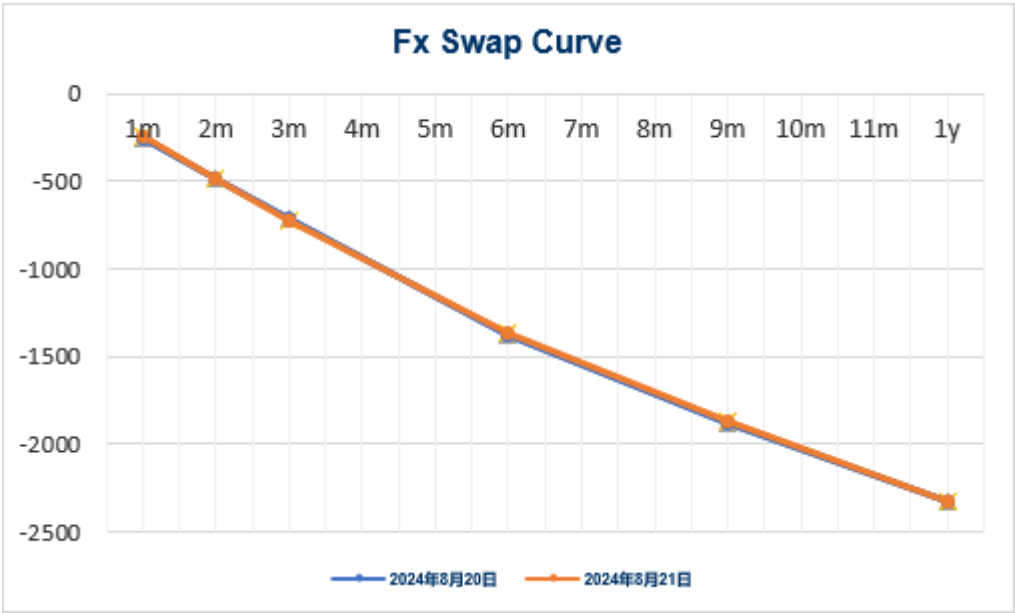
中长期，6s 成交在 -1360， -1350 的位置；9s 成交在 -1850 的位置；1y 成交在 -2319， -2317 的位置。

超长期，18s 成交在 -3000 的位置。

Spread 上， 3s*6s 成交在 -632 的位置；1s*2s 成交在 -234 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1286	-0.6
2W	14	-110	7.1229	0
1M	31	-246	7.1093	5.7
2M	61	-482	7.0857	-2
3M	94	-730	7.0609	-14.2
6M	185	-1365	6.9974	7
9M	273	-1868	6.9471	9
1Y	367	-2322	6.9017	4
18M	549	-3000	6.8339	0
2Y	731	-3650	6.7689	15
3Y	1095	-4680	6.6659	80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1307	
CLOSING SPOT RATE			7.1339	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-236	-484	-1119	-1622	-2076
2M		-248	-883	-1386	-1840
3M			-635	-1138	-1592
6M				-503	-957
9M					-454



文 / Edward Sun

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