



【2024-09-03】

今日 Fixing 定在 7.1112，较上一交易日下调了 85 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

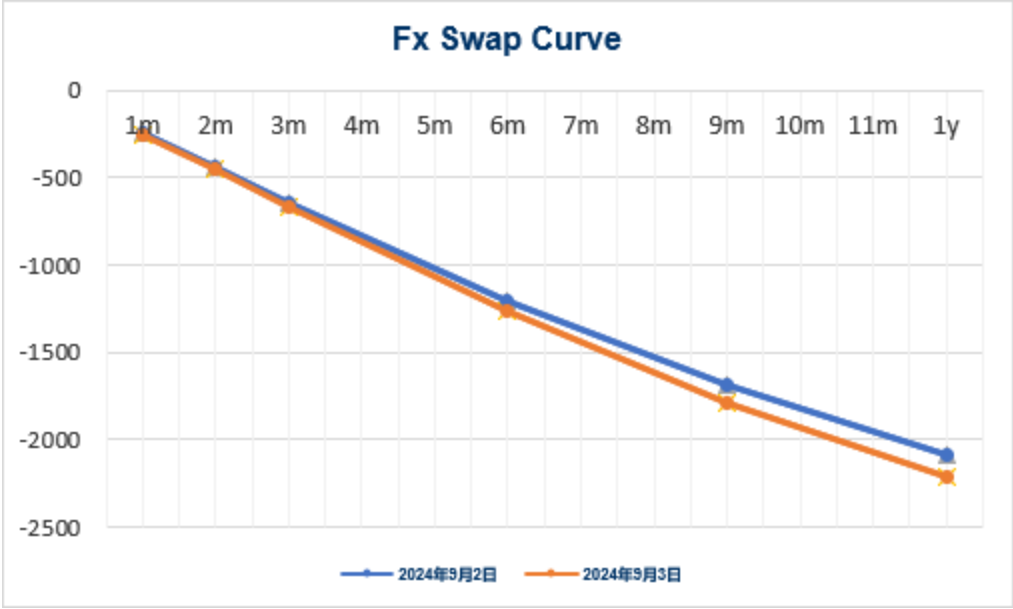
短端，O/N 成交在 -9~-7.5 的位置；T/N 成交在 -8~-7.5 的位置；S/N 成交在 -8~-7.61 的位置。1w 成交在 -55 的位置；3w 成交在 -160 的位置；1s 成交在 -250，-249，-248 的位置；3s 成交在 -670，-668，-663，-665，-654，-648 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1243，-1242 的位置；9s 成交在 -1783，-1770 的位置；1y 成交在 -2200，-2170 的位置。

超长期限，18s 成交在 -2775，-2750，-2740 的位置；2y 成交在 -3220 的位置；3y 成交在 -4250 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-55	7.1116	-2.4
2W	14	-109	7.1062	-3
1M	33	-253	7.0918	-4.1
2M	61	-454	7.0717	-12
3M	91	-668	7.0503	-21
6M	181	-1261	6.9910	-54
9M	273	-1785	6.9386	-99
1Y	365	-2210	6.8961	-118
18M	546	-2815	6.8356	-160
2Y	733	-3299	6.7872	-189
3Y	1097	-4250	6.6921	-250
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1112	
CLOSING SPOT RATE			7.1171	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-201	-415	-1008	-1532	-1957
2M		-214	-807	-1331	-1756
3M			-593	-1117	-1542
6M				-524	-949
9M					-425



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