

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-09-02】

今日 Fixing 定在 7.1027, 较上一交易日上调了 97 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所上行。

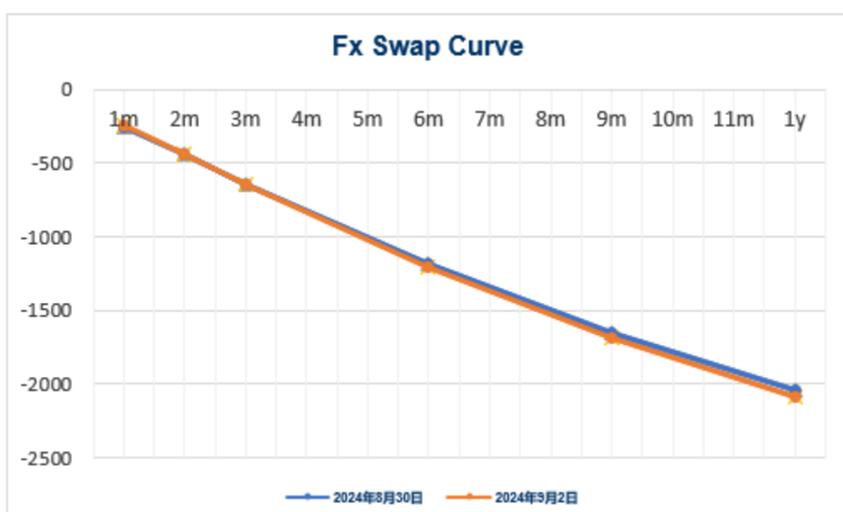
短端, T/N 成交在 -7.7~-7.5 的位置; S/N 成交在 -7.7~-7.61 的位置。1w 成交在 -53.3, -53.15 的位置; 2w 成交在 -106 的位置; 1s 成交在 -248.9 的位置; 2s 成交在 -440 的位置; 3s 成交在 -646, -645, -644 的位置。

中长期限, 6s 成交在 -1204, -1203 的位置; 9s 成交在 -1685 的位置; 1y 成交在 -2088, -2085, -2083 的位置。

超长期限, 18s 成交在 -2655 的位置; 2y 成交在 -3110 的位置; 3y 成交在 -4000 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1062	0.6
2W	14	-106	7.1009	7
1M	34	-249	7.0866	4.1
2M	61	-442	7.0673	2
3M	91	-647	7.0468	-8
6M	181	-1207	6.9908	-27
9M	273	-1686	6.9429	-31
1Y	365	-2092	6.9023	-55
18M	546	-2655	6.8460	-55
2Y	730	-3110	6.8005	-110
3Y	1098	-4000	6.7115	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1027	
CLOSING SPOT RATE			7.1115	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-193.1	-398.1	-958.1	-1437.1	-1843.1
2M		-205	-765	-1244	-1650
3M			-560	-1039	-1445
6M				-479	-885
9M					-406



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