



【2024-09-12】

今日 Fixing 定在 7.1214。较上一交易日上升了 32 个 bp，各期限收盘价较上一交易日略微有所下降，交投较活跃。

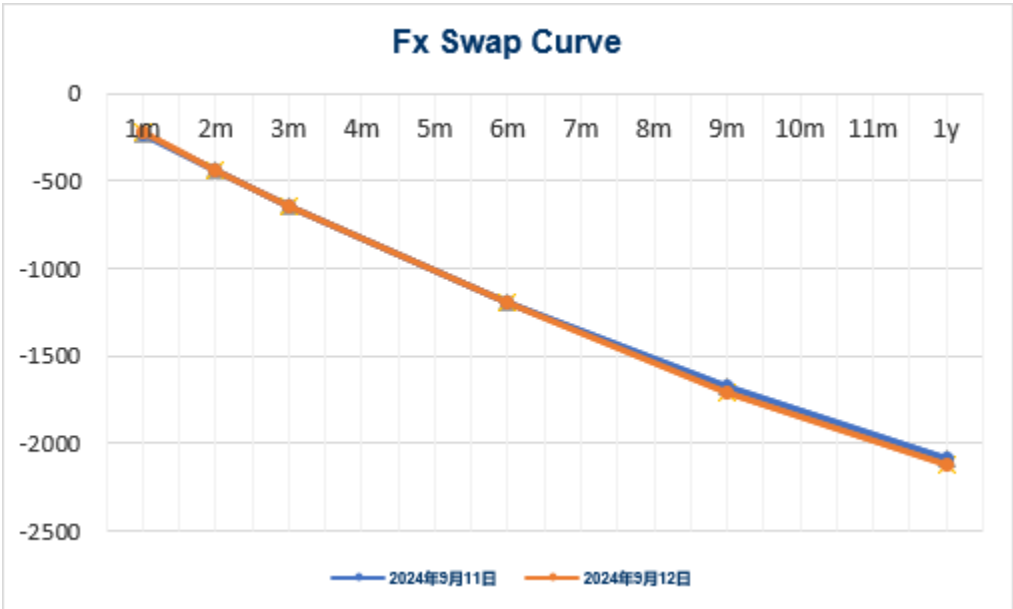
短端，O/N 主要成交在-8.5~-7.3。 T/N 主要成交在-40~-37.3。 S/N 主要成交在-7.65~-7.55。1w 主要成交在-53， -52.7， -52.6， -52.57， -52.55 等位置。2w 市场成交在-150 等位置。3w 市场成交在-155 的位置。1s 成交在-222， -221， -220.3， -220 等位置，尾盘收在-220.5 的位置。2s 成交在-443， -441， -440 等位置。3s 主要成交在-647， -643， -640， -638， -637， -639， -644 等位置，尾盘收在-643 附近。4s 主要成交在-852， -849， -848， -847 等位置，尾盘收在-853 的位置。

中长期限，6s 成交在-1200， -1198， -1193， -1186， -1187， -1188， -1195 等位置，尾盘收在-1195 附近。9s 市场成交在-1700， -1685， -1680， -1690 等位置，尾盘收在-1700 附近的位置。1y 主要成交在-2125， -2110， -2100， -2090， -2093， -2099， -2102， -2115 等位置，尾盘收在-2116 附近。

Spread 方面，3*4s 成交在-210， -211 的位置。9*12s 成交在-410， -411 的位置。6*12s 成交在-915， -920 等位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1183	0.51
2W	20	-150	7.1086	-45
1M	30	-220	7.1016	16
2M	61	-442	7.0795	2
3M	91	-641	7.0595	1.2
6M	181	-1195	7.0041	-5
9M	273	-1705	6.9531	-27
1Y	365	-2121	6.9115	-37
18M	546	-2670	6.8566	-10
2Y	730	-3075	6.8161	-25
3Y	1097	-3975	6.7261	25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1214	
CLOSING SPOT RATE			7.1236	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-221.5	-420.8	-975	-1485	-1901
2M		-199.3	-753.5	-1263.5	-1679.5
3M			-554.2	-1064.2	-1480.2
6M				-510	-926
9M					-416



文 / Yiff Wang

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