



【2024-09-18】

今日 Fixing 定在 7.0870，较上一交易日下调了 160 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

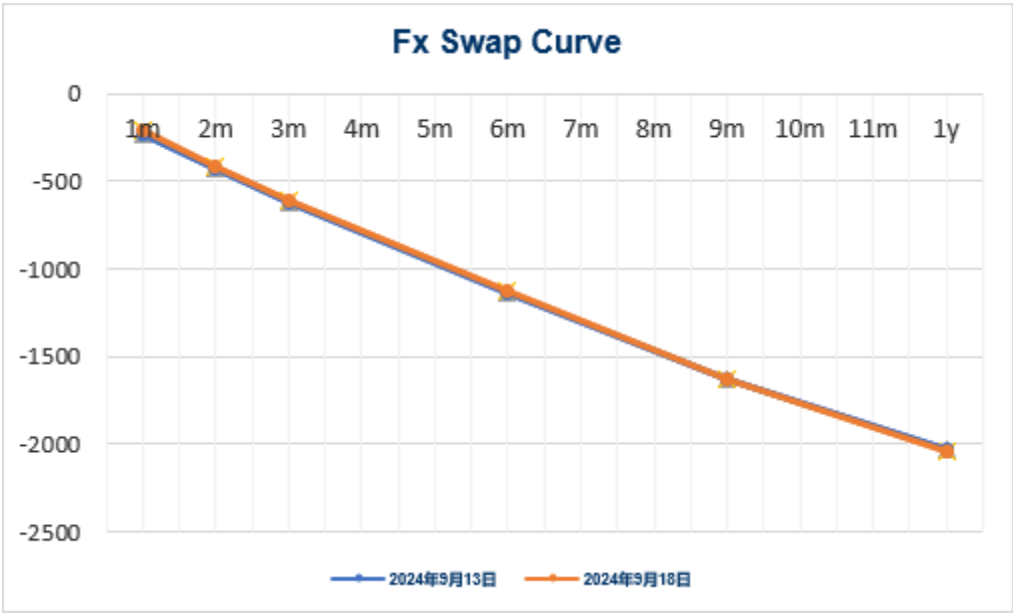
短端，O/N 成交在 -7.3~-6.8 的位置；T/N 成交在 -7.34~-7.08 的位置；S/N 成交在 -21.68~-20.65 的位置。2w 成交在 -126，-125 的位置；1s 成交在 -217.2，-216.7 的位置；2s 成交在 -422，-421 的位置；3s 成交在 -612 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1134，-1133，-1129 的位置；9s 成交在 -1626，-1622 的位置；1y 成交在 -2045，-2043，-2040，-2035，-2027，-2025 的位置。

Spread 上，2s*1y 成交在 -1605 的位置；6s*1y 成交在 -909，-908 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.0845	2.3
2W	18	-125	7.0768	12
1M	31	-215	7.0678	12
2M	61	-417	7.0476	9
3M	91	-610	7.0283	11
6M	181	-1131	6.9762	11
9M	273	-1630	6.9263	2
1Y	367	-2042	6.8851	-10
18M	546	-2600	6.8293	-40
2Y	731	-3010	6.7883	-60
3Y	1095	-3975	6.6918	-80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0870	
CLOSING SPOT RATE			7.0893	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-202	-395	-916	-1415	-1827
2M		-193	-714	-1213	-1625
3M			-521	-1020	-1432
6M				-499	-911
9M					-412



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