



【2024-08-26】

今日 Fixing 定在 7.1139，较上一交易日下调了 219 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

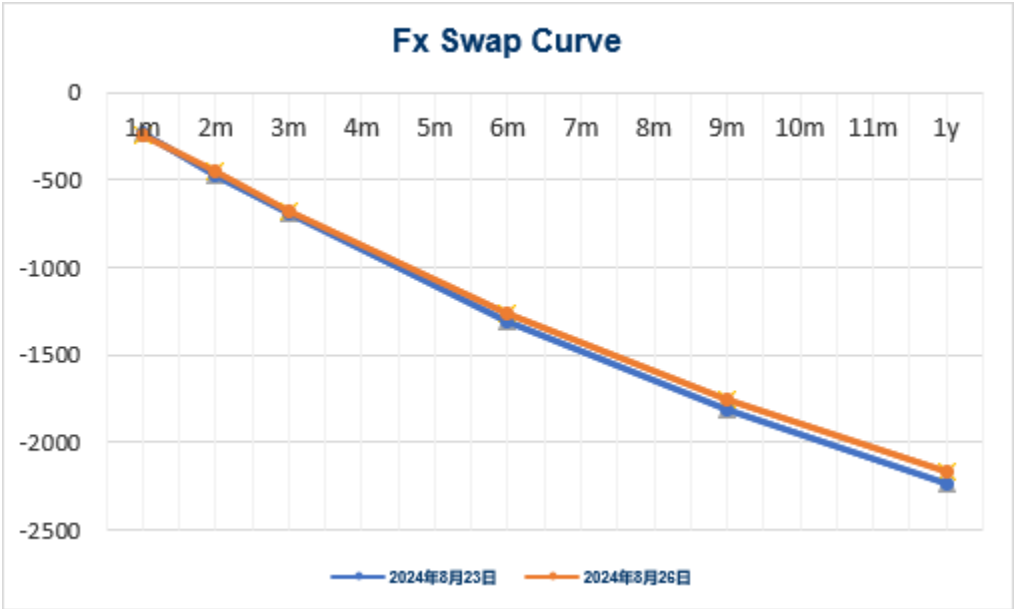
短端，O/N 成交在 -6.7~-6.5 的位置；T/N 成交在 -7.11~-6.89 的位置；S/N 成交在 -7.5 ~-7.01 的位置。1w 成交在 -51.5，-51.2，-51，-50.8 的位置；2w 成交在 -103 的位置；3w 成交在 -155 的位置；1s 成交在 -245.5，-244.5，-242.3 的位置；2s 成交在 -447.5 的位置；3s 成交在 -678，-677，-673 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1262，-1260 的位置；9s 成交在 -1753，-1752 的位置；1y 成交在 -2165，-2160，-2150 的位置。

Spread 上，2w\*3w 成交在 -52 的位置；3w\*1s 成交在 -88 的位置。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 7    | -51        | 7.1137       | 2          |
| 2W                      | 14   | -103       | 7.1085       | 4          |
| 1M                      | 33   | -245       | 7.0943       | -9         |
| 2M                      | 61   | -447       | 7.0741       | 23         |
| 3M                      | 93   | -678       | 7.0510       | 11.8       |
| 6M                      | 184  | -1265      | 6.9923       | 45         |
| 9M                      | 273  | -1754      | 6.9434       | 58         |
| 1Y                      | 365  | -2163      | 6.9025       | 74         |
| 18M                     | 548  | -2800      | 6.8388       | 100        |
| 2Y                      | 730  | -3375      | 6.7813       | 175        |
| 3Y                      | 1097 | -4350      | 6.6838       | 200        |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 7.1139       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 7.1188       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |      |        |        |         |         |
|---------------------|------|--------|--------|---------|---------|
|                     | 2M   | 3M     | 6M     | 9M      | 1Y      |
| 1M                  | -202 | -433.2 | -1020  | -1509   | -1918   |
| 2M                  |      | -231.2 | -818   | -1307   | -1716   |
| 3M                  |      |        | -586.8 | -1075.8 | -1484.8 |
| 6M                  |      |        |        | -489    | -898    |
| 9M                  |      |        |        |         | -409    |



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