



【2024-08-08】

今日 Fixing 定在 7.1460，较上一交易日下调了 74 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~-8 的位置；T/N 成交在 -26.35~-24.6 的位置；S/N 成交在 -8.75~-8.5 的位置。1w 成交在 -60.2， -60.15， -60 的位置；3w 成交在 -193 的位置；1s 成交在 -279， -278， -272.5 的位置；2s 成交在 -562， -558 的位置；3s 成交在 -793， -790， -780， -778 的位置。

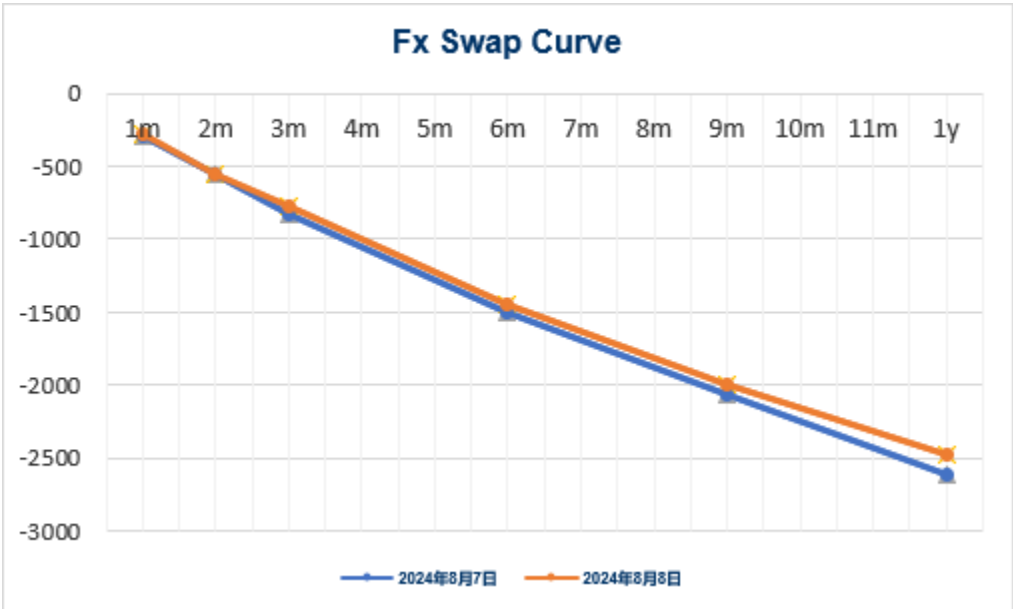
中长期限，6s 成交在 -1465， -1463， -1462 的位置；9s 成交在 -2018， -2008， -2000 的位置；1y 成交在 -2525， -2520， -2495， -2480 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3310 的位置；3y 成交在 -5050 的位置。

Spread 上，3s*4s 成交在 -232 的位置；2s*5s 成交在 -675， -674 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-61	7.1568	4.1
2W	14	-121	7.1508	8
1M	31	-276	7.1353	10.1
2M	64	-560	7.1069	-9
3M	92	-779	7.0850	49
6M	184	-1447	7.0182	55
9M	273	-1993	6.9636	72
1Y	365	-2476	6.9153	142
18M	549	-3305	6.8324	170
2Y	730	-4050	6.7579	155
3Y	1095	-5050	6.6579	240
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1460	
CLOSING SPOT RATE			7.1629	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-284.4	-503.4	-1171.4	-1717.4	-2200.4
2M		-219	-887	-1433	-1916
3M			-668	-1214	-1697
6M				-546	-1029
9M					-483



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