



【2024-08-14】

今日 Fixing 定在 7.1415，较上一交易日下调了 64 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

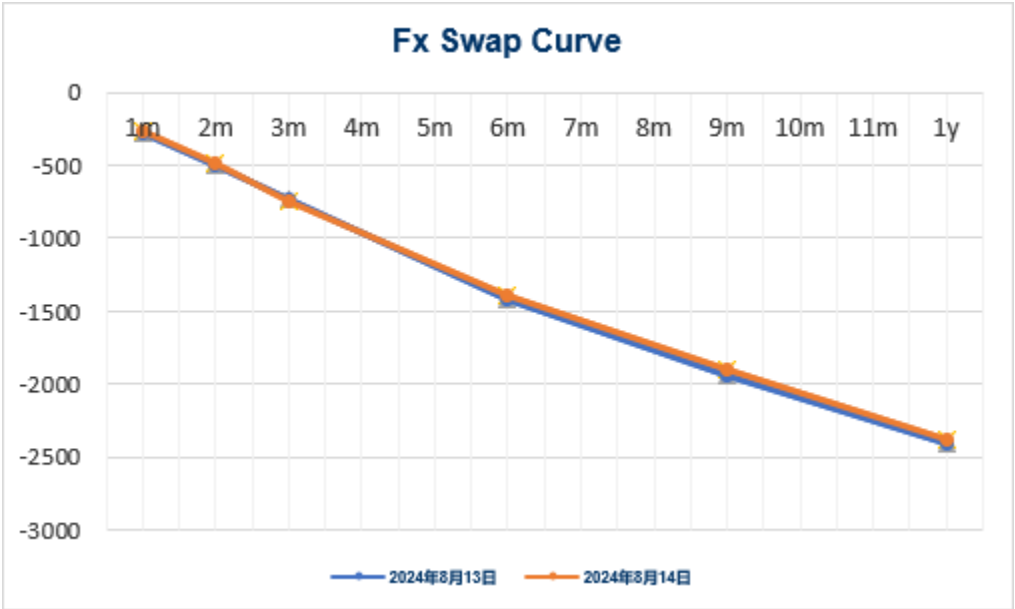
短端，O/N 成交在 -7.1~-6.5 的位置；T/N 成交在 -7.23~-6.8 的位置；S/N 成交在 -22.1~-21.85 的位置。1w 成交在 -52.8, -52.7, -52.6 的位置；1s 成交在 -264.5, -264 的位置；2s 成交在 -490, -489, -488 的位置；3s 成交在 -745, -744, -740 的位置；4s 成交在 -950 的位置；5s 成交在 -1170 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1390 的位置；9s 成交在 -1925, -1898, -1890 的位置；1y 成交在 -2390, -2380, -2370, -2365 的位置。

Spread 上，2s*3s 成交在 -253 的位置；3s*4s 成交在 -210 的位置；6s*9s 成交在 -505 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1431	0.25
2W	14	-107	7.1377	2
1M	33	-264	7.1220	8.9
2M	61	-489	7.0995	5
3M	94	-742	7.0742	-9
6M	186	-1390	7.0094	30
9M	273	-1895	6.9589	40
1Y	367	-2374	6.9110	34
18M	556	-3175	6.8309	25
2Y	731	-3850	6.7634	50
3Y	1095	-4820	6.6664	130
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1415	
CLOSING SPOT RATE			7.1484	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-225.1	-478.1	-1126.1	-1631.1	-2110.1
2M		-253	-901	-1406	-1885
3M			-648	-1153	-1632
6M				-505	-984
9M					-479



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