



【2024-09-19】

今日 Fixing 定在 7.0983，较上一交易日上升了 113 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端，O/N 主要成交在-6.7~-6。 T/N 主要成交在-20.2~-18.2 的位置。S/N 主要成交在-6.55~-6.3 的位置。1w 成交-45.5，-45.2，-45，-44.3 等位置。2w 成交在-100，-99，-98.5，-98，-97，-96.3 的位置。3w 成交在-143，-142 的位置。1s 成交在-200，-195，-193，-191 等位置。2s 成交在-400，-390 等位置。3s 成交在-553，-547 等位置。4s 成交在-704，-705，-710 等位置，尾盘收在-704 的位置。

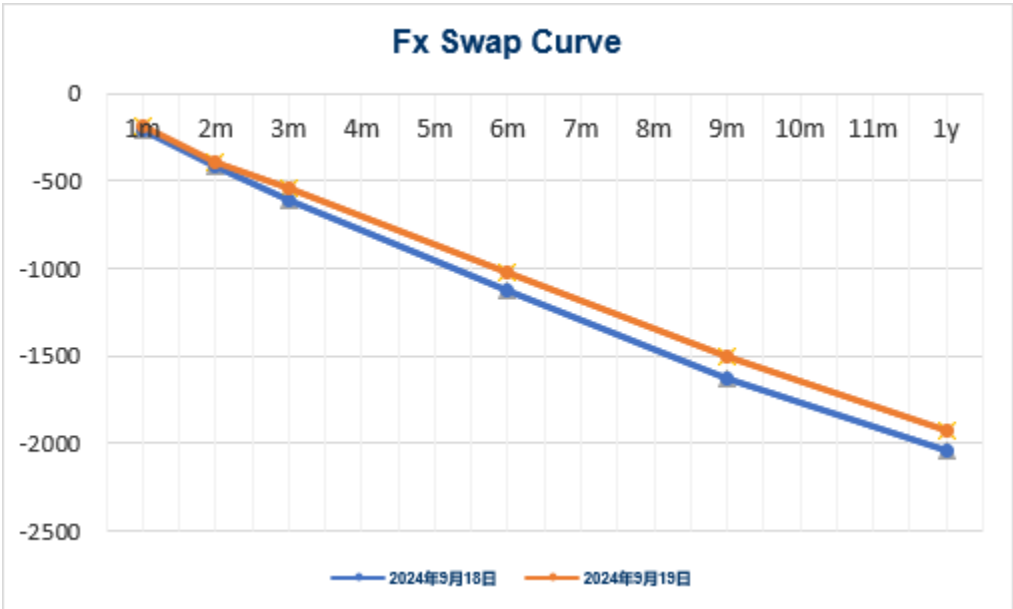
中长期限，6s 成交在-1100，-1060，-1045，-1030，-1026 等位置。9s 成交在-1570，-1540，-1520，-1515，-1510，-1505 等位置。1y 成交在-2000，-1970，-1948，-1928，-1920 等位置。

超长期限，18s 成交在-2470 的位置。

Spread 方面，1w*2w 成交在-53，-52 的位置。6*9s 成交在-483 的位置。9*12s 成交在-411 的位置。6*12s 成交在-894，-897 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	7.0616	3.85
2W	15	-96	7.0564	29
1M	30	-192	7.0469	23.5
2M	63	-390	7.0270	27
3M	91	-547	7.0113	63
6M	182	-1025	6.9635	106
9M	273	-1508	6.9152	122
1Y	365	-1922	6.8738	120
18M	546	-2470	6.8190	130
2Y	730	-2850	6.7810	160
3Y	1095	-3800	6.6860	175
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0983	
CLOSING SPOT RATE			7.0660	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-198.5	-355.5	-833.5	-1316.5	-1730.5
2M		-157	-635	-1118	-1532
3M			-478	-961	-1375
6M				-483	-897
9M					-414



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