



【2024-08-27】

今日 Fixing 定在 7.1249，较上一交易日上调了 110 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

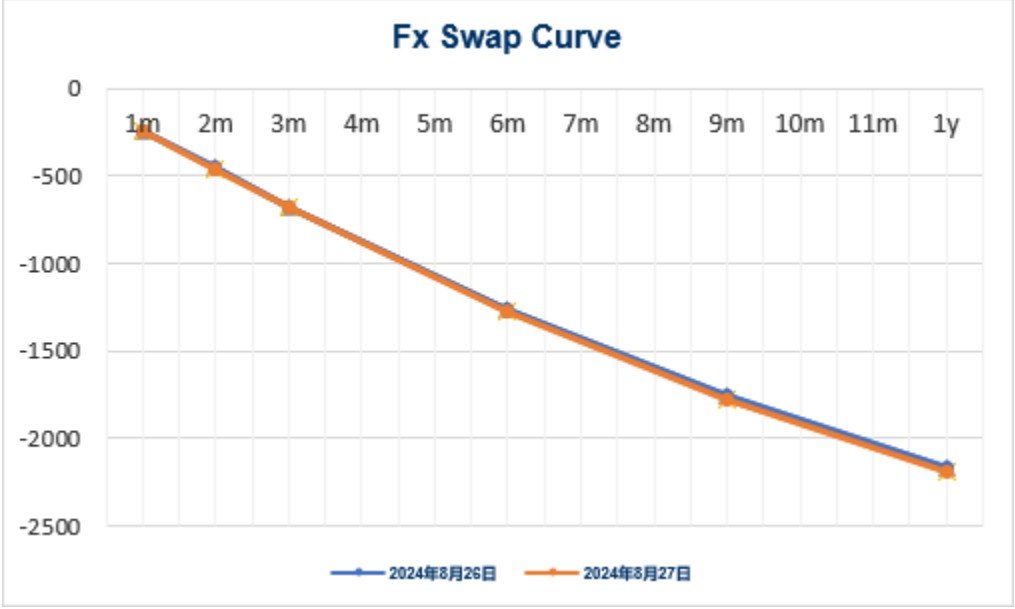
短端，O/N 成交在 -9~-7.3 的位置；T/N 成交在 -7.8~-7.2 的位置；S/N 成交在 -7.7 ~-7.1 的位置。1w 成交在 -54 的位置；2w 成交在 -108.35，-108 的位置；3w 成交在 -163.5 的位置；1s 成交在 -246，-245，-244 的位置；2s 成交在 -460，-459 的位置；3s 成交在 -680，-579，-677 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1273，-1270，-1269 的位置；9s 成交在 -1781 的位置；1y 成交在 -2195，-2185，-2180，-2175 的位置。

Spread 上，1s*3s 成交在 -434.5 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-55	7.1241	-3.7
2W	14	-108	7.1188	-5
1M	32	-245	7.1051	-0.1
2M	61	-459	7.0838	-12
3M	92	-681	7.0616	-2.3
6M	183	-1278	7.0018	-13
9M	273	-1776	6.9520	-22
1Y	365	-2192	6.9104	-29
18M	547	-2830	6.8466	-30
2Y	732	-3300	6.7996	75
3Y	1096	-4315	6.6981	35
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1249	
CLOSING SPOT RATE			7.1296	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-213.4	-435.4	-1032.9	-1530.9	-1946.9
2M		-222	-819.5	-1317.5	-1733.5
3M			-597.5	-1095.5	-1511.5
6M				-498	-914
9M					-416



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