



【2024-08-13】

今日 Fixing 定在 7.1479，较上一交易日上调了 21 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 -7.1~-6.6 的位置；T/N 成交在 -7.16~-7 的位置；S/N 成交在 -7.25~-7.19 的位置。1w 成交在 -52.9 的位置；1s 成交在 -274 的位置；3s 成交在 -745.5，-742，-740，-734 的位置；5s 成交在 -1199 的位置。

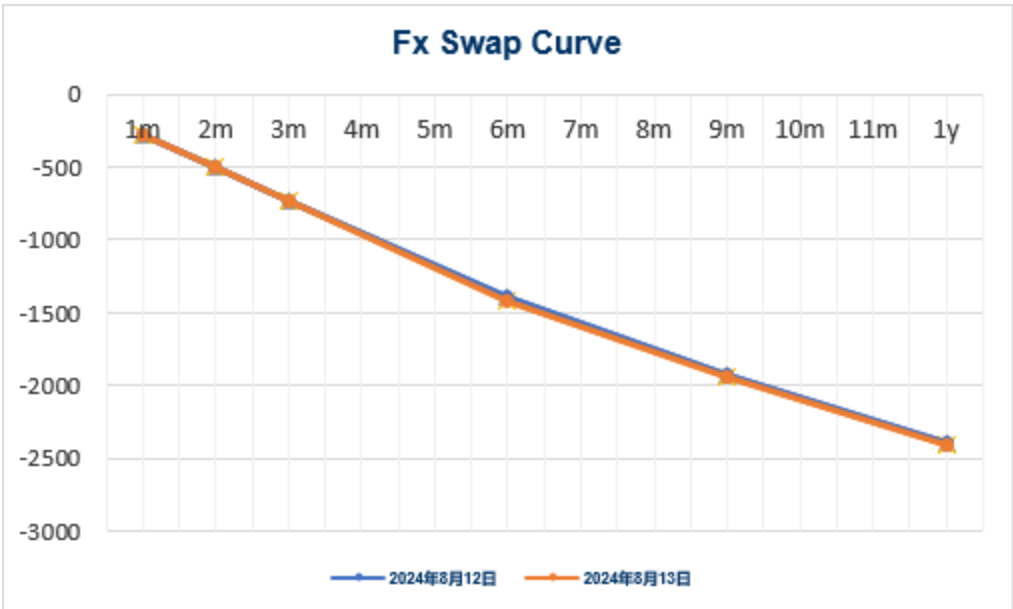
中长期限，6s 成交在 -1433，-1432，-1423，-1417，-1414 的位置；9s 成交在 -1945，-1930，-1927 的位置；1y 成交在 -2419，-2412，-2405 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3220 的位置。

Spread 上，4s*5s 成交在 -214 的位置；5s*6s 成交在 -228 的位置；6s*9s 成交在 -510 的位置；6s*1y 成交在 -983 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1641	-0.05
2W	14	-109	7.1585	-1
1M	34	-273	7.1421	4.2
2M	61	-494	7.1200	1
3M	92	-733	7.0961	-2
6M	187	-1420	7.0274	-25
9M	273	-1935	6.9759	-13
1Y	365	-2408	6.9286	-7
18M	557	-3200	6.8494	40
2Y	732	-3900	6.7794	5
3Y	1096	-4950	6.6744	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1479	
CLOSING SPOT RATE			7.1694	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-221.2	-460.2	-1147.2	-1662.2	-2135.2
2M		-239	-926	-1441	-1914
3M			-687	-1202	-1675
6M				-515	-988
9M					-473



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