



【2024-09-04】

今日 Fixing 定在 7.1148，较上一交易日下调了 36 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

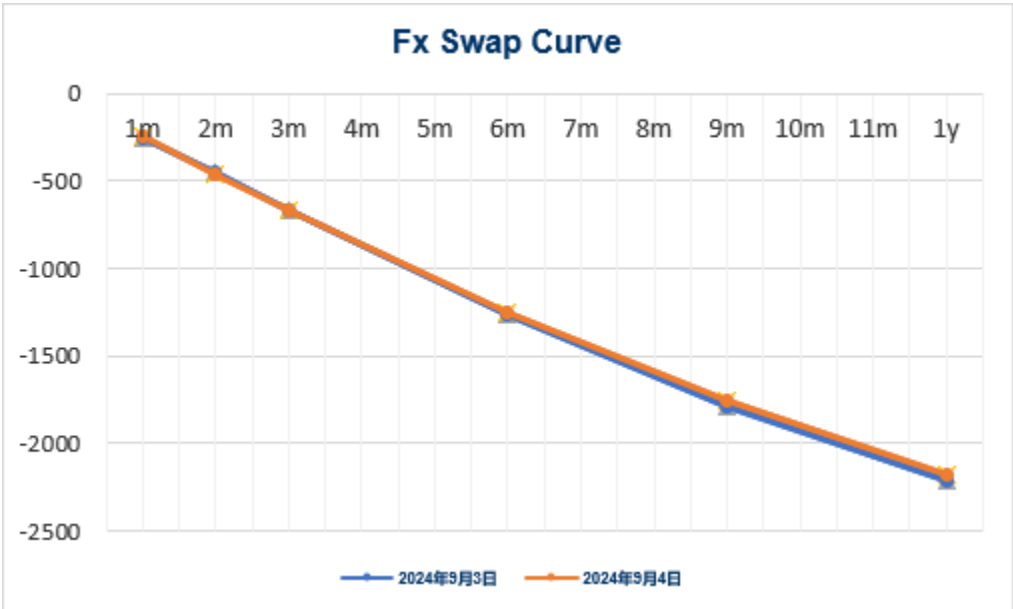
短端，O/N 成交在 -8~-7.7 的位置；T/N 成交在 -8.25~-7.81 的位置；S/N 成交在 -24.15~-23.8 的位置。1w 成交在 -55.1，-55 的位置；2w 成交在 -111 的位置；1s 成交在 -249，-248 的位置；3s 成交在 -669，-668，-667，-666，-665，-661，-660 的位置；4s 成交在 -894，-880 的位置；5s 成交在 -1080 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1240 的位置；9s 成交在 -1761.5，-1760 的位置；1y 成交在 -2225，-2205，-2180，-2174，-2160 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -589 的位置；6s*9s 成交在 -520，-515 的位置；4s*5s 成交在 -200 的位置；1s*3s 成交在 -419 的位置；6s*12s 成交在 -928 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-55	7.1080	0.3
2W	14	-110	7.1025	-1
1M	32	-247	7.0888	6.2
2M	61	-458	7.0677	-4
3M	91	-665	7.0470	3
6M	181	-1248	6.9887	13
9M	273	-1759	6.9376	26
1Y	367	-2175	6.8960	35
18M	546	-2760	6.8375	55
2Y	732	-3260	6.7875	39
3Y	1096	-4150	6.6985	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1148	
CLOSING SPOT RATE			7.1135	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-211.2	-418.2	-1001.2	-1512.2	-1928.2
2M		-207	-790	-1301	-1717
3M			-583	-1094	-1510
6M				-511	-927
9M					-416



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