



【2024-08-09】

今日 Fixing 定在 7.1449，较上一交易日上调了 11 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

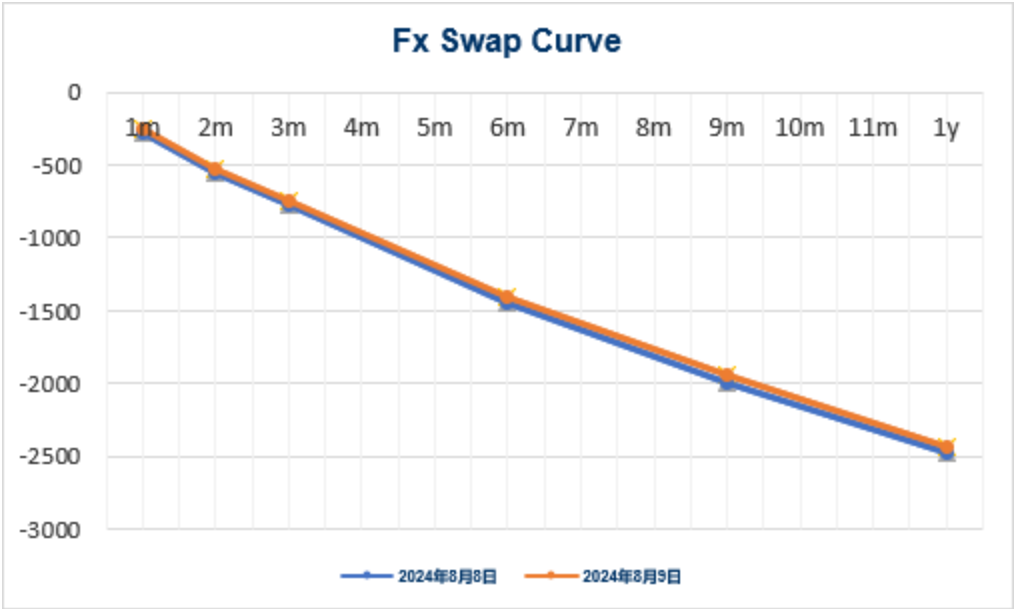
短端，O/N 成交在 -22.5~-21.4 的位置；T/N 成交在 -8.2~-7.64 的位置；S/N 成交在 -7.95~-7.7 的位置。1w 成交在 -56.5，-56.2，-56 的位置；2w 成交在 -111.3 的位置；1s 成交在 -265，-262，-255 的位置；2s 成交在 -520 的位置；3s 成交在 -750 的位置；4s 成交在 -985 的位置；5s 成交在 -1190 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1410 的位置；1y 成交在 -2450，-2448，-2445，-2442，-2440，-2438 的位置。

Spread 上，1w*2s 成交在 -56 的位置；1s*3s 成交在 -495 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-56	7.1690	4.8
2W	14	-112	7.1634	9
1M	31	-255	7.1491	20.6
2M	63	-520	7.1227	41
3M	92	-750	7.0996	29
6M	184	-1402	7.0344	45
9M	273	-1945	6.9801	48
1Y	365	-2439	6.9307	37
18M	549	-3290	6.8456	15
2Y	730	-3990	6.7756	60
3Y	1095	-5000	6.6746	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1449	
CLOSING SPOT RATE			7.1746	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-264.5	-495	-1147	-1690	-2184
2M		-230.5	-882.5	-1425.5	-1919.5
3M			-652	-1195	-1689
6M				-543	-1037
9M					-494



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