【2024-09-26】

今日 Fixing 定在 7.0354，较上一交易日上升了 152 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-6.8~-5.8。 T/N 主要成交在-19~-16.1 的位置。1w 成交在-50，-49.8，-49.5，-49，-48.5，-47.5，-46，-45.3 等位置，尾盘收在-45.3。2w 成交在-93，-92，-91，-90，-88.5 的位置。3w 成交在-130.75，-129 的位置。1s 成交在-195，-192，-190，-188 等位置。2s 成交在-361 的位置。3s 成交在-548，-547，-546，-545，-544，-542，-540，-541，-540，-539 等位置。

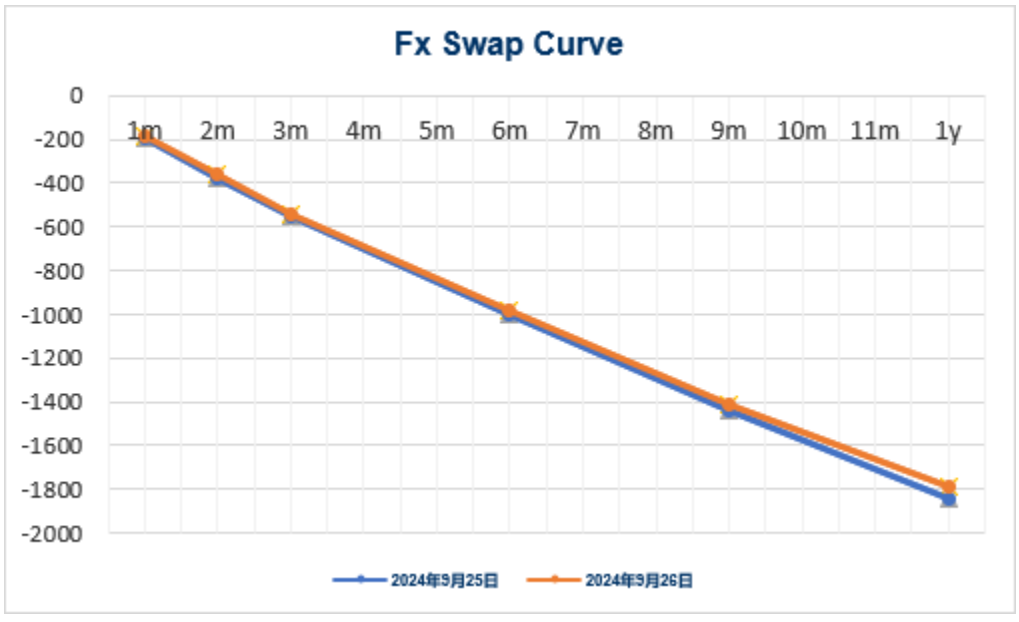
中长期限，6s 成交在-1001，-1000，-998，-995，-992，-991，-990，-985，-987，-983，-980 等位置。9s 成交在-1435，-1428，-1425，-1415，-1410 等位置。1y 成交在-1820，-1818，-1825，-1815，-1810，-1800，-1795，-1785 等位置。

超长期限，2y 成交在-2680 的位置。

Spread 方面，2*3s 成交在-180 的位置。3*9s 成交在-885 的位置。3*12s 成交在-1270，-1260 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-45	7.0155	24.4
2W	15	-89	7.0112	0
1M	31	-188	7.0012	8.7
2M	60	-362	6.9838	16
3M	92	-540	6.9660	9
6M	182	-984	6.9216	16
9M	273	-1413	6.8787	32
1Y	365	-1791	6.8409	49
18M	547	-2300	6.7900	30
2Y	730	-2700	6.7500	30
3Y	1095	-3378	6.6822	82
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0354	
CLOSING SPOT RATE			7.0200	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-173.6	-351.7	-795.7	-1224.7	-1602.7
2M		-178.1	-622.1	-1051.1	-1429.1
3M			-444	-873	-1251
6M				-429	-807
9M					-378



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。