



【2024-08-22】

今日 Fixing 定在 7.1228，较上一交易日上调了 79 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

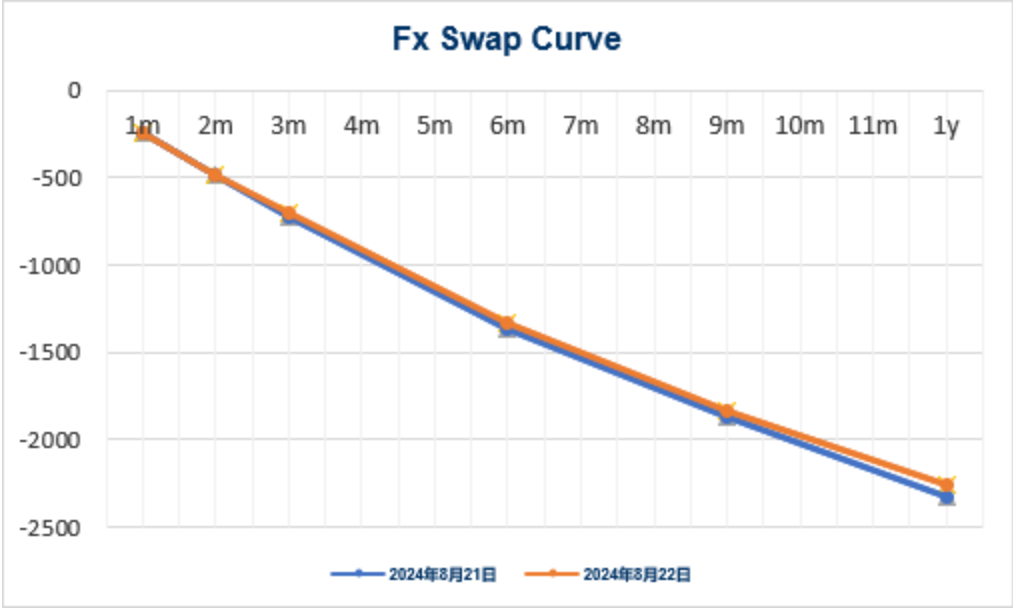
短端，O/N 成交在 -7.8~-7.2 的位置；T/N 成交在 -22.2~-21.5 的位置；S/N 成交在 -7.5 ~-7.35 的位置。1w 成交在 -62 的位置；2w 成交在 -109 的位置；3w 成交在 -179 的位置；1s 成交在 -246，-245 的位置；2s 成交在 -490 的位置；3s 成交在 -715 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1334 的位置；9s 成交在 -1850 的位置；1y 成交在 -2290 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -46.7 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-62	7.1314	-9.05
2W	14	-109	7.1267	1
1M	31	-242	7.1135	4.5
2M	63	-490	7.0886	-8
3M	92	-707	7.0670	23.5
6M	184	-1327	7.0049	38
9M	274	-1830	6.9546	38
1Y	365	-2256	6.9120	66
18M	549	-2925	6.8451	75
2Y	730	-3575	6.7801	75
3Y	1095	-4600	6.6776	80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1228	
CLOSING SPOT RATE			7.1376	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-248.3	-465	-1085.5	-1588.5	-2014.5
2M		-216.7	-837.2	-1340.2	-1766.2
3M			-620.5	-1123.5	-1549.5
6M				-503	-929
9M					-426



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