【2024-09-05】

今日 Fixing 定在 7.0989，较上一交易日上调了 159 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 -7.6~-7.4 的位置；T/N 成交在 -24~-23.45 的位置；S/N 成交在 -7.8~-7.72 的位置。1w 成交在 -70.65 的位置；2w 成交在 -109 的位置；3w 成交在 -161 位置；1s 成交在 -228.5，-228.2，-228 的位置；2s 成交在 -474，-472，-471，-470 的位置；3s 成交在 -663，-661，-659 的位置。

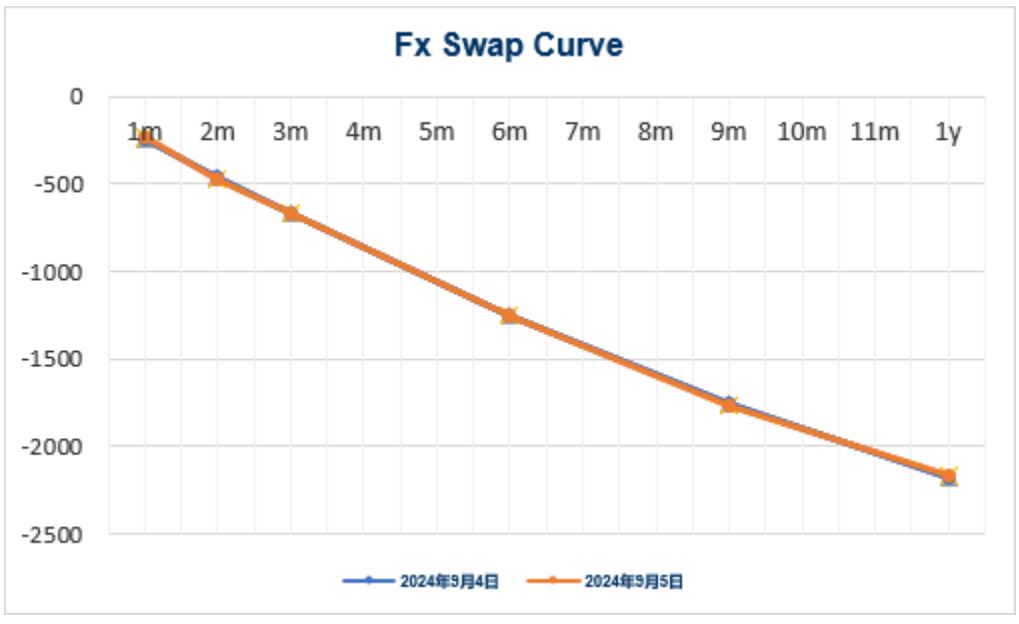
中长期限，6s 成交在 -1249，-1243，-1239，-1235，-1234，-1230 的位置；9s 成交在 -1720，-1710 的位置；1y 成交在 -2160，-2155，-2130，-2125，-2122，-2120，-2115，-2109，-2105 的位置。

超长期限，18s 成交在 -2770 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -575 的位置；6s*12s 成交在 -892，-890，-888 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	9	-70	7.0925	-15.3
2W	14	-109	7.0886	1
1M	30	-229	7.0766	18.2
2M	64	-475	7.0520	-17
3M	91	-662	7.0333	3
6M	182	-1251	6.9745	-3
9M	273	-1765	6.9231	-5.5
1Y	365	-2171	6.8824	4
18M	546	-2780	6.8215	-20
2Y	730	-3260	6.7735	0
3Y	1095	-4210	6.6785	-60
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0989	
CLOSING SPOT RATE			7.0995	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-246.4	-433.4	-1021.9	-1535.9	-1942.4
2M		-187	-775.5	-1289.5	-1696
3M			-588.5	-1102.5	-1509
6M				-514	-920.5
9M					-406.5



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