



【2024-09-09】

今日 Fixing 定在 7.0989，较上一交易日上调了 64 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 -8.3~-7.7 的位置；T/N 成交在 -8.13~-8 的位置；S/N 成交在 -8~-7.95 的位置。1w 成交在 -55.5， -55.4， -55.3， -54.8 的位置；1s 成交在 -227 的位置；2s 成交在 -456 的位置；3s 成交在 -658， -657 的位置；4s 成交在 -870， -869， -868 的位置。

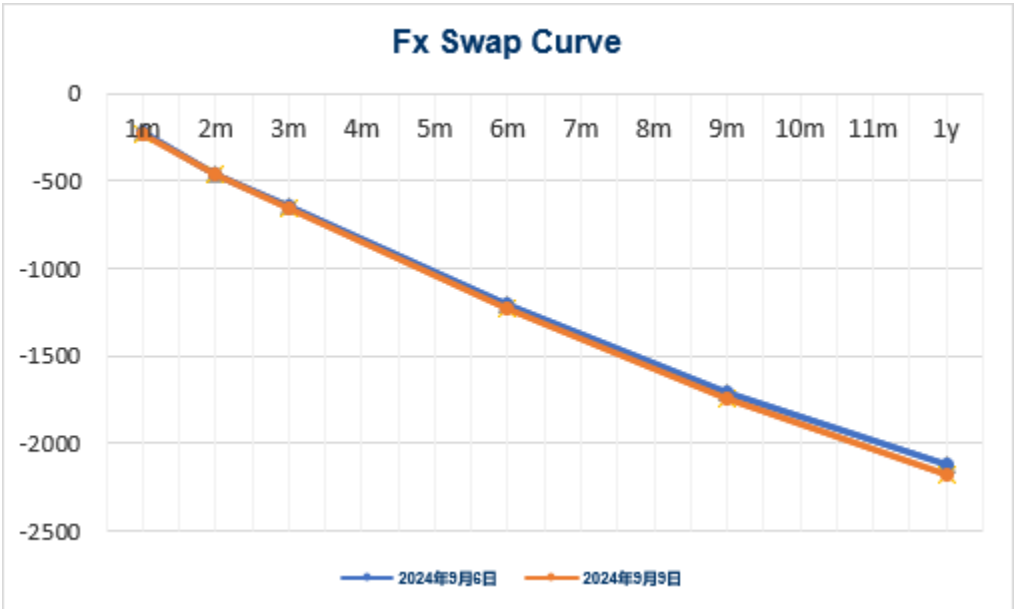
中长期限，6s 成交在 -1212 的位置；9s 成交在 -1720， -1710 的位置；1y 成交在 -2165， -2163， -2153， -2135， -2130， -2125， -2115 的位置。

超长期限，2y 成交在 -3200， -3198 的位置。

Spread 上，6s*12s 成交在 -912 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-55	7.1093	7.3
2W	14	-109	7.1040	0
1M	27	-227	7.0921	-1
2M	62	-459	7.0689	0
3M	91	-657	7.0491	-8
6M	181	-1229	6.9920	-21
9M	273	-1746	6.9402	-31.5
1Y	365	-2180	6.8968	-55
18M	546	-2740	6.8408	-35
2Y	730	-3205	6.7943	-55
3Y	1097	-4115	6.7033	10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0989	
CLOSING SPOT RATE			7.1148	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-231.6	-429.6	-1001.1	-1518.6	-1952.6
2M		-198	-769.5	-1287	-1721
3M			-571.5	-1089	-1523
6M				-517.5	-951.5
9M					-434



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