



【2024-07-03】

今日 Fixing 定在 7.1312，较上一交易日上调了 21 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 -14.8~-14 的位置；S/N 成交在 -22.81~-22.76 的位置。1w 较多成交在 -53，-52.95 的位置；3w 成交在 -159 的位置；1s 成交在 -238.5 的位置；3s 成交在 -758 的位置，成交寡淡。

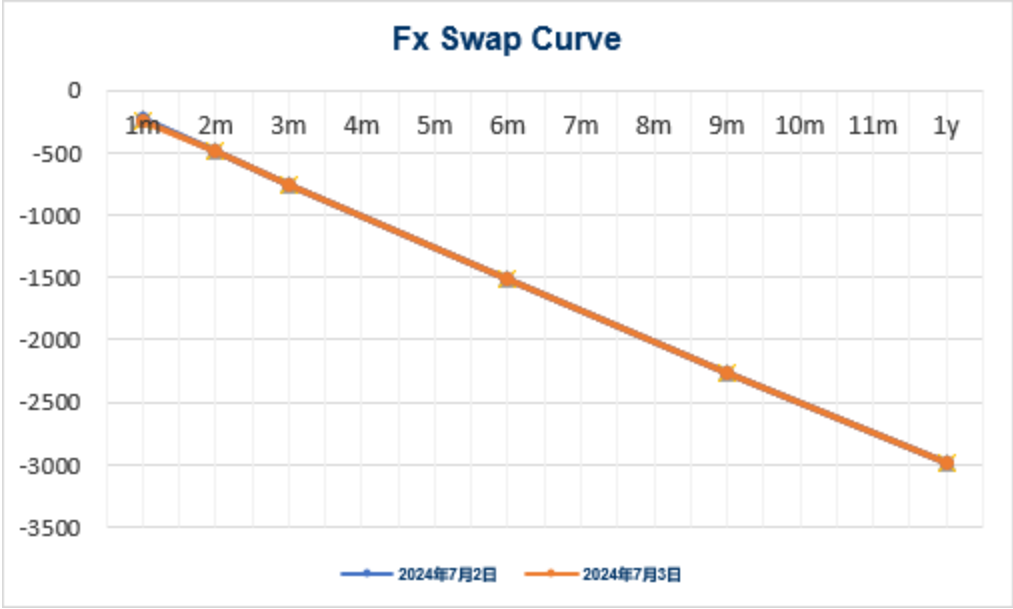
中长期限，6s 成交主要成交 -1509 的位置；9s 成交在 -2270 的位置；1y 今日成交较多，开盘在 -2991 的位置，较多成交在 -2993，-2992 的位置，尾盘收在 -2990 的位置。

超长期限，18s 成交在 -4190 的位置；3y 成交在 -6200 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -753，-751 的位置；6s*9s 成交在 -760 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2681	-0.45
2W	14	-106	7.2628	0
1M	31	-238	7.2496	-1.5
2M	62	-485	7.2249	-2
3M	95	-756	7.1978	-0.5
6M	185	-1508	7.1226	-5
9M	276	-2265	7.0469	-3
1Y	367	-2985	6.9749	0
18M	549	-4185	6.8549	-30
2Y	731	-5070	6.7664	-10
3Y	1096	-6210	6.6524	-25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1312	
CLOSING SPOT RATE			7.2734	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-246.6	-517.6	-1269.6	-2026.6	-2746.6
2M		-271	-1023	-1780	-2500
3M			-752	-1509	-2229
6M				-757	-1477
9M					-720



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