



【2024-07-18】

今日 Fixing 定在 7.1285，较上一交易日上调了 33 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 -7.75~-7.6 的位置；T/N 成交在 -23.6~-22.9 的位置；S/N 成交在 -7.87~-7.7 的位置。1w 较多成交在 -53.8 的位置；3w 成交在 -164 的位置；1s 成交在 -241.5 的位置；2s 成交在 -497.7 的位置；3s 成交在 -730，-729.5，-729 的位置；4s 成交在 -976 的位置。

中长期，6s 成交主要成交 -1468，-1467，-1465 的位置；9s 成交在 -2180，-2175 的位置；1y 今日成交较多，开盘在 -2891 的位置，随后一路走高，较多成交在 -2890，-2875 的位置，尾盘收在 -2870 的位置。

超长期，18s 成交在 -4020，-3990，-3980 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -54.5 的位置；6s*9s 成交在 -707 的位置；6s*1y 成交在 -1405 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-54	7.2518	-0.34
2W	14	-109	7.2464	-1
1M	31	-242	7.2330	-1
2M	63	-498	7.2074	-9
3M	92	-730	7.1842	15.2
6M	184	-1469	7.1103	18
9M	274	-2168	7.0404	32
1Y	365	-2865	6.9707	31
18M	549	-3991	6.8581	59
2Y	730	-4840	6.7732	60
3Y	1095	-5920	6.6652	80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1285	
CLOSING SPOT RATE			7.2572	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-255.8	-488	-1227	-1926	-2623
2M		-232.2	-971.2	-1670.2	-2367.2
3M			-739	-1438	-2135
6M				-699	-1396
9M					-697

