



【2024-08-01】

今日 Fixing 定在 7.1323，较上一交易日下调了 23 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 -9.3~-8 的位置；T/N 成交在 -25.6~-25 的位置；S/N 成交在 -8.45~-8.4 的位置。1w 成交在 -58.6 的位置；2w 成交在 -117.8 的位置；3w 成交在 -175 的位置；1s 成交在 -258，-257.5 的位置；3s 成交在 -770 的位置。

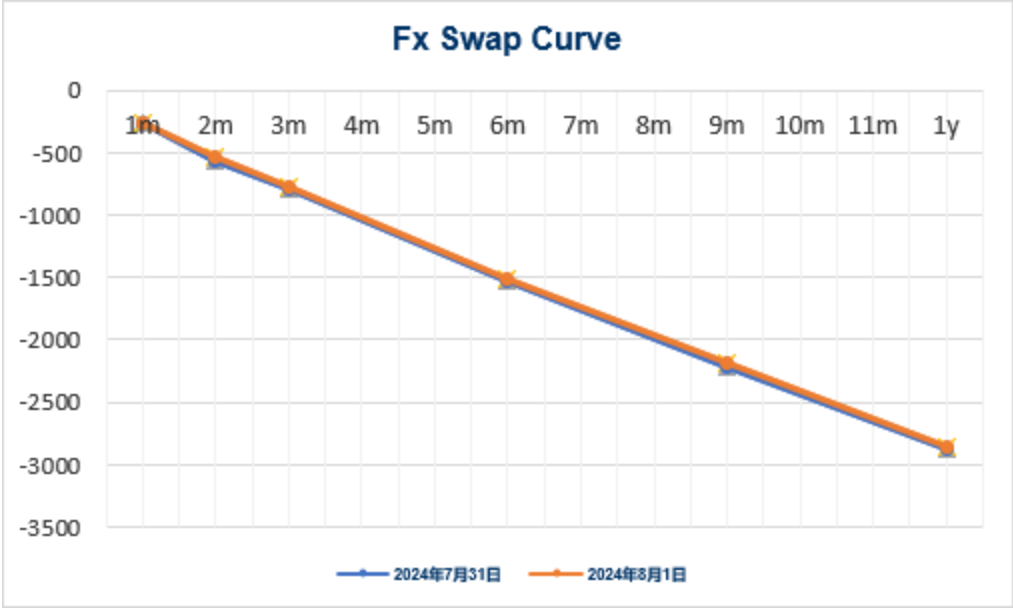
中长期，6s 成交在 -1511，-1506，-1505 的位置；9s 成交在 -2177 的位置；1y 成交在 -2850，-2840，-2836，-2830 的位置，尾盘收在 -2852 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3875 的位置。

Spread，2w*1s 成交在 -140 的位置；6s*1y 成交在 -1335，-1330，-1325 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-59	7.2387	1.32
2W	14	-118	7.2328	-1
1M	31	-260	7.2186	6
2M	64	-540	7.1906	25
3M	92	-771	7.1675	15
6M	184	-1515	7.0931	11
9M	274	-2190	7.0256	25
1Y	365	-2852	6.9594	22
18M	549	-3880	6.8566	60
2Y	730	-4680	6.7766	70
3Y	1095	-5810	6.6636	90
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1323	
CLOSING SPOT RATE			7.2446	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-280.4	-511	-1255	-1930	-2592
2M		-230.6	-974.6	-1649.6	-2311.6
3M			-744	-1419	-2081
6M				-675	-1337
9M					-662



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