



【2024-07-24】

今日 Fixing 定在 7.1358，较上一交易日下调了 24 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 的位置；T/N 成交在 -8.42~-8 的位置；S/N 成交在 -25.22~-24.91 的位置。1w 成交在 -58.4，-58，-57.9 的位置；2w 成交在 -115.5，-115 的位置；3s 成交在 -770 的位置。

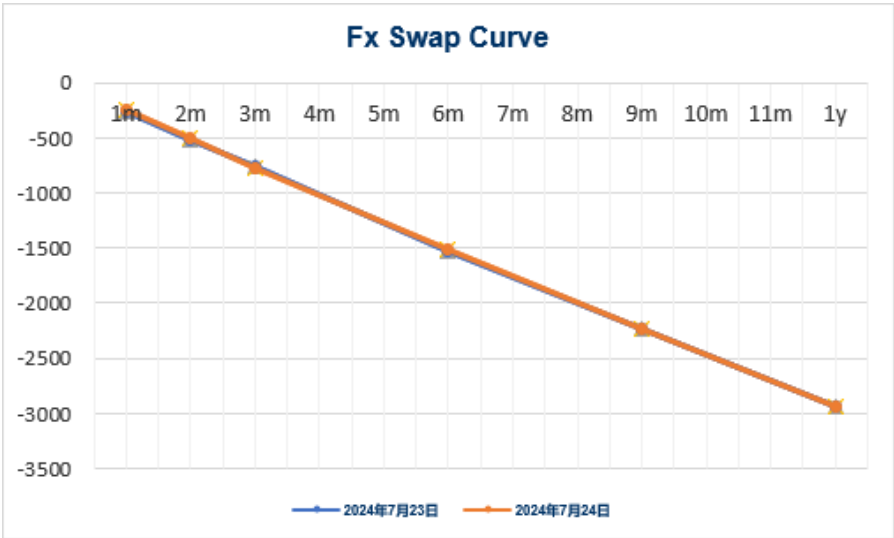
中长期，6s 成交主要成交 -1519，-1518，-1516，-1514 的位置；1y 今日成交较多，开盘在 -2939.5 的位置，随后一路走高，较多成交在 -2939，-2937，-2930 的位置，尾盘收在 -2930 的位置。

超长期限，18s 成交在 -4060 的位置；2y 成交在 -4940 的位置；3y 成交在 -6110 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -57.3 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-58	7.2702	0.39
2W	14	-115	7.2645	0
1M	31	-252	7.2508	10.9
2M	62	-506	7.2254	4
3M	94	-771	7.1989	-14.94
6M	185	-1517	7.1243	15
9M	276	-2235	7.0525	-3
1Y	367	-2940	6.9820	3
18M	549	-4070	6.8690	40
2Y	731	-4960	6.7800	40
3Y	1095	-6100	6.6660	40
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1358	
CLOSING SPOT RATE			7.2760	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-253.54	-518.9	-1264.9	-1982.9	-2687.9
2M		-265.36	-1011.36	-1729.36	-2434.36
3M			-746	-1464	-2169
6M				-718	-1423
9M					-705



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