



【2024-07-12】

今日 Fixing 定在 7.1315，较上一交易日上调了 24 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

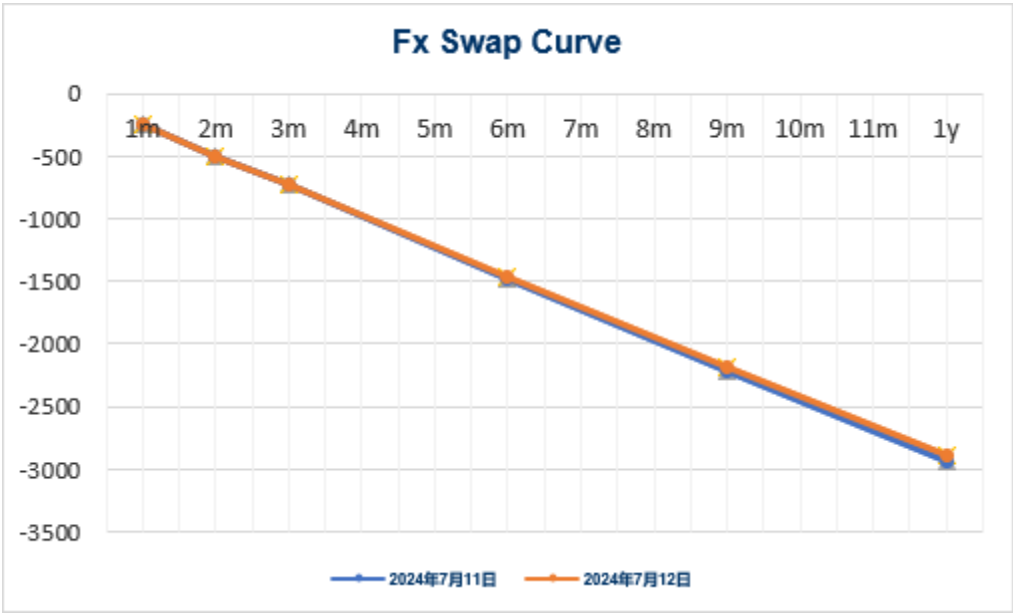
短端，O/N 成交在 -22.4~-22 的位置；T/N 成交在 -7.5~-7.42 的位置；S/N 成交在 -7.53~-7.44 的位置。1w 较多成交在 -52.45，-52.35，-52.3 的位置；3w 成交在 -159.5 的位置；1s 成交在 -237.7，-237.5 的位置；3s 成交在 -723.8 的位置，成交寡淡；4s 成交在 -988 的位置；5s 成交在 -1214，-1213 的位置。

中长期，6s 成交主要成交 -1467，-1466，-1465，-1462 的位置；9s 成交在 -2195，-2194，-2188 的位置；1y 今日成交较多，开盘在 -2885 的位置，随后一路走低，较多成交在 -2895，-2894 的位置，尾盘收在 -2895 的位置。

Spread 上，3w*1s 成交在 -78 的位置；1s*3s 成交在 -486 的位置；6s*9s 成交在 -726.5；9s*1y 成交在 -698.5 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2532	0.31
2W	14	106	7.2691	212
1M	31	-238	7.2347	0
2M	64	-499	7.2087	10
3M	92	-724	7.1861	2.4
6M	184	-1467	7.1118	13
9M	274	-2191	7.0394	27
1Y	365	-2894	6.9691	37
18M	549	-4050	6.8535	55
2Y	730	-4910	6.7675	50
3Y	1095	-6025	6.6560	-27
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1315	
CLOSING SPOT RATE			7.2585	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-260.6	-485.9	-1229.1	-1953.1	-2656.1
2M		-225.3	-968.5	-1692.5	-2395.5
3M			-743.2	-1467.2	-2170.2
6M				-724	-1427
9M					-703



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