



【2024-07-08】

今日 Fixing 定在 7.1286，较上一交易日上调了 3 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 -7.1~-6.5 的位置；T/N 成交在 -7.19~-7.15 的位置；S/N 成交在 -7.24~-7.21 的位置。1w 较多成交在 -51.35，-51.3 的位置；2w 成交在 -104 的位置；1s 成交在 -251，-250.8 的位置；3s 成交在 -723，-722.5，-722 的位置，成交寡淡；4s 成交在 -990，-989 的位置；5s 成交在 -1216，-1215 的位置。

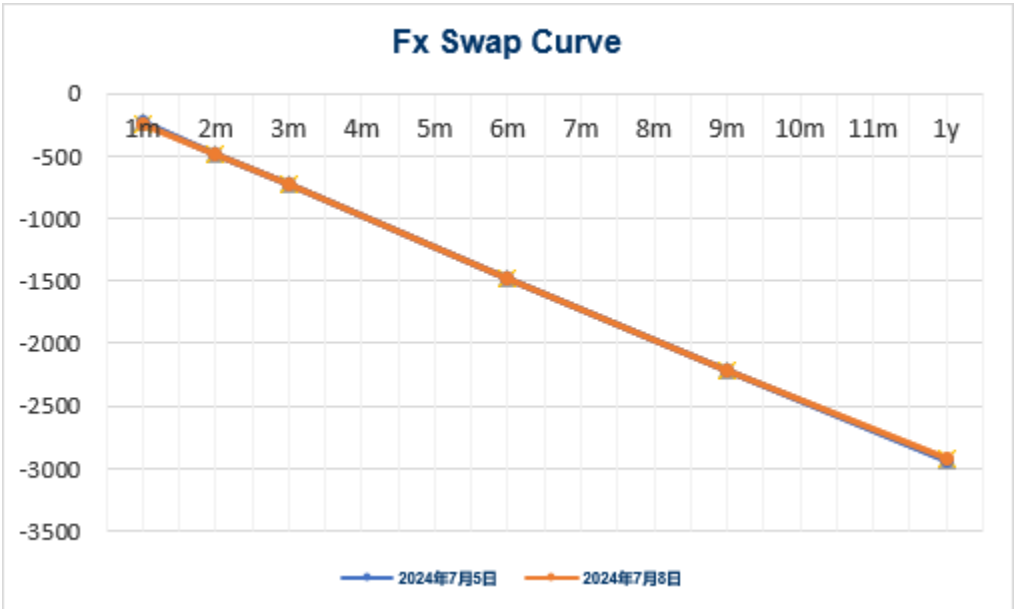
中长期，6s 成交主要成交 -1472，-1471，-1467 的位置；9s 成交在 -2210 的位置；1y 今日成交较多，开盘在 -2905 的位置，随后一路走低，较多成交在 -2925，-2921 的位置，尾盘收在 -2925 的位置。

超长期限，18s 成交在 -4100，-4095，-4085 的位置。

Spread 上，3s*4s 成交在 -268 的位置；4s*5s 成交在 -226 的位置；3s*6s 成交在 -749，-748.5 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.2647	0.53
2W	14	-104	7.2594	0
1M	33	-251	7.2447	-16.1
2M	62	-481	7.2217	1
3M	92	-723	7.1975	-0.2
6M	184	-1473	7.1226	6
9M	274	-2213	7.0485	5
1Y	365	-2926	6.9772	4
18M	551	-4105	6.8593	-5
2Y	730	-4950	6.7748	25
3Y	1097	-5975	6.6723	120
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1286	
CLOSING SPOT RATE			7.2698	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-230	-471.8	-1221.5	-1962	-2675
2M		-241.8	-991.5	-1732	-2445
3M			-749.7	-1490.2	-2203.2
6M				-740.5	-1453.5
9M					-713



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