



【2024-07-25】

今日 Fixing 定在 7.1321，较上一交易日上调了 37 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 ~-8.2 的位置；T/N 成交在 -26~-24.98 的位置；S/N 成交在 -8.33~-8.27 的位置。1w 成交在 -58.2， -58.1 的位置；1s 成交在 -253.6 的位置；2s 成交在 -516.6 的位置；3s 成交在 -753， -752 的位置；5s 成交在 -1251 的位置。

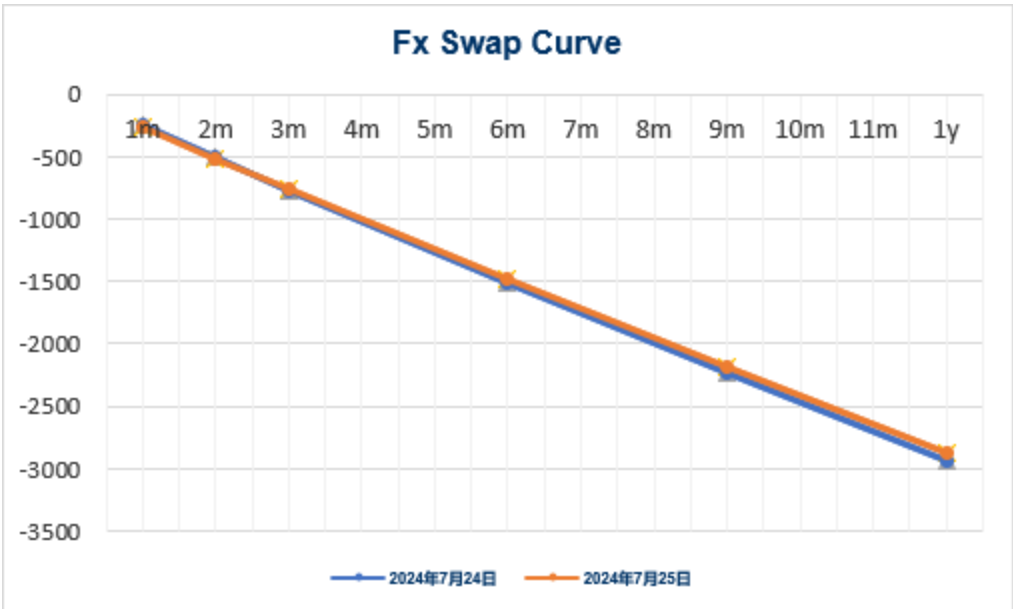
中长期，6s 成交主要成交 -1480 的位置；9s 成交在 -2190 的位置；1y 今日成交较多，开盘在 -2921.5 的位置，随后一路走高，较多成交在 -2921， -2900， -2897， -2896， -2894， -2870 的位置，尾盘收在 -2870 的位置。

超长期限，18s 成交在 -4050， -4010 的位置；3y 成交在 -4835 的位置。

Spread 上，1s*2s 成交在 -263 的位置；2s*3s 成交在 -234 的位置；4s*5s 成交在 -250， -248 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-58	7.2145	-0.44
2W	14	-116	7.2087	-1
1M	31	-254	7.1949	-2.1
2M	63	-517	7.1686	-11
3M	92	-753	7.1450	18
6M	182	-1475	7.0728	42
9M	274	-2183	7.0020	52
1Y	365	-2870	6.9333	70
18M	549	-3980	6.8223	90
2Y	730	-4750	6.7453	210
3Y	1095	-5950	6.6253	150
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1321	
CLOSING SPOT RATE			7.2203	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-262.8	-498.8	-1220.8	-1928.8	-2615.8
2M		-236	-958	-1666	-2353
3M			-722	-1430	-2117
6M				-708	-1395
9M					-687



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