【2024-07-01】

今日 Fixing 定在 7.1265，较上一交易日下调了 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。

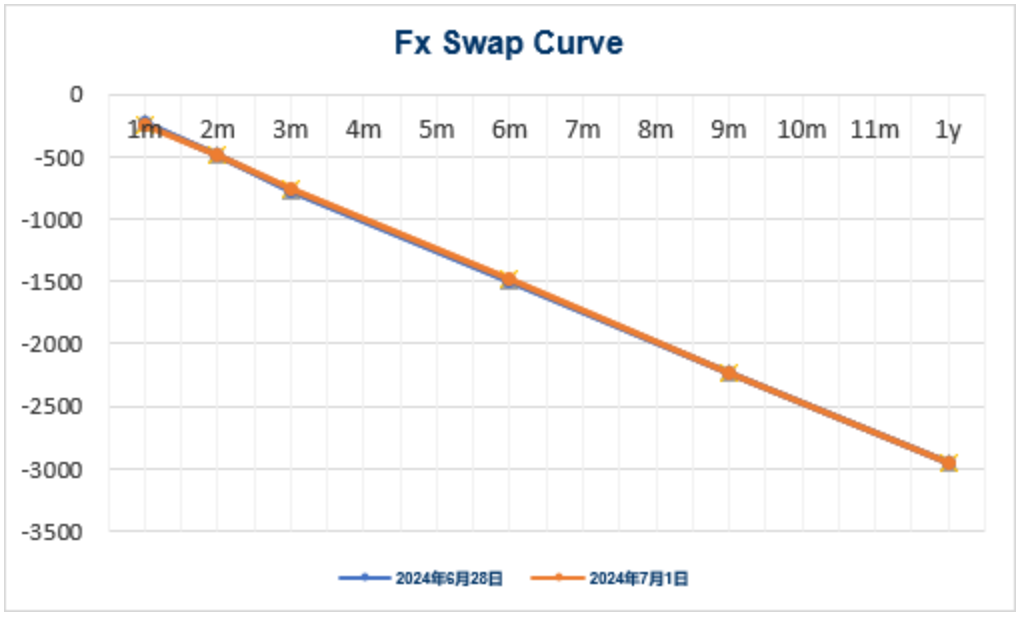
短端，O/N 成交在 -7.4~-7 的位置；T/N 成交在 -7.37~-7.22 的位置；S/N 成交在 -14.75~-14.6 的位置。1w 较多成交在 -52.21，-52.2，-52.1 的位置；2w 成交在 -104.3 的位置；3w 成交在 -156.5 的位置；1s 成交在 -249，-248 的位置；2s 成交在 -480，-479 的位置；3s 成交在 -766 的位置；5s 成交在 -1228 的位置。

中长期限，6s 成交主要成交 -1486，-1484 的位置；9s 成交在 -2230 的位置；1y 成交在 -2960，-2950，-2947，-2946 的位置。

Spread 上，3w*1s 成交在 -92.5 的位置；1w*2w 成交在 -52.2 的位置；9s*1y 成交在 -720 的位置；1y*2y 成交在 -2042 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2632	-0.35
2W	14	-105	7.2580	-1
1M	31	-249	7.2435	-17
2M	63	-480	7.2204	7
3M	98	-766	7.1918	9.35
6M	184	-1486	7.1198	4
9M	274	-2230	7.0454	9
1Y	365	-2948	6.9736	14
18M	552	-4115	6.8569	35
2Y	730	-4990	6.7694	30
3Y	1095	-6120	6.6564	-55
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1265	
CLOSING SPOT RATE			7.2684	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-231	-516.65	-1237	-1981	-2699
2M		-285.65	-1006	-1750	-2468
3M			-720.35	-1464.35	-2182.35
6M				-744	-1462
9M					-718



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。