



【2024-07-30】

今日 Fixing 定在 7.1364，较上一交易日上调了 48 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

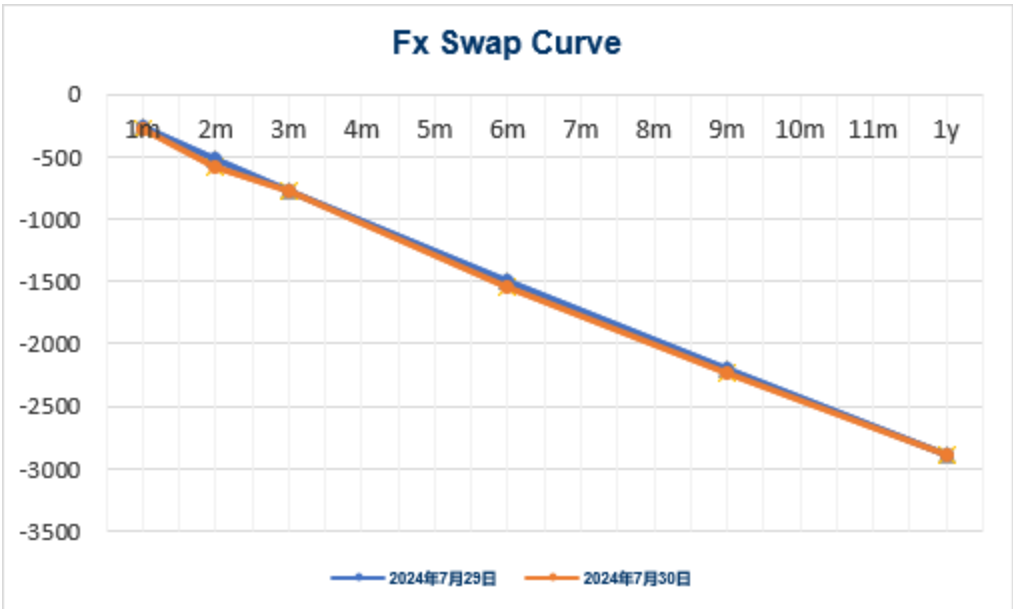
短端，O/N 成交在 -8.5~-8 的位置；T/N 成交在 -12.5~-10.5 的位置；S/N 成交在 -9~-8.94 的位置。1w 成交在 -60.9 的位置；2w 成交在 -119.4 的位置；1s 成交在 -81，-280，-277.5 的位置；3s 成交在 -772，-771 的位置。

中长期，6s 成交在 -1538，-1537，-1536 的位置；9s 成交在 -2235 的位置；1y 成交在 -2887，-2884，-2879 的位置，尾盘收在 -2898 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3970，-3955 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-61	7.2411	14.75
2W	14	-119	7.2353	15
1M	33	-277	7.2195	-11.7
2M	68	-575	7.1897	-53
3M	92	-771	7.1701	4.5
6M	187	-1545	7.0927	-56
9M	278	-2240	7.0232	-38
1Y	365	-2889	6.9583	1
18M	550	-3970	6.8502	0
2Y	732	-4800	6.7672	20
3Y	1096	-5940	6.6532	10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1364	
CLOSING SPOT RATE			7.2472	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-297.55	-493.85	-1267.85	-1962.85	-2611.85
2M		-196.3	-970.3	-1665.3	-2314.3
3M			-774	-1469	-2118
6M				-695	-1344
9M					-649



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