



【2024-07-15】

今日 Fixing 定在 7.1313，较上一交易日上调了 2 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

短端，O/N 成交在 -7.6~-7.3 的位置；T/N 成交在 -7.83~-7.35 的位置；S/N 成交在 -7.72~-7.4 的位置。1w 较多成交在 -52.9，-52.8，-52.5 的位置；1s 成交在 -254.6，-253.8，-251 的位置；3s 成交在 -729，-728.4 的位置，成交寡淡。

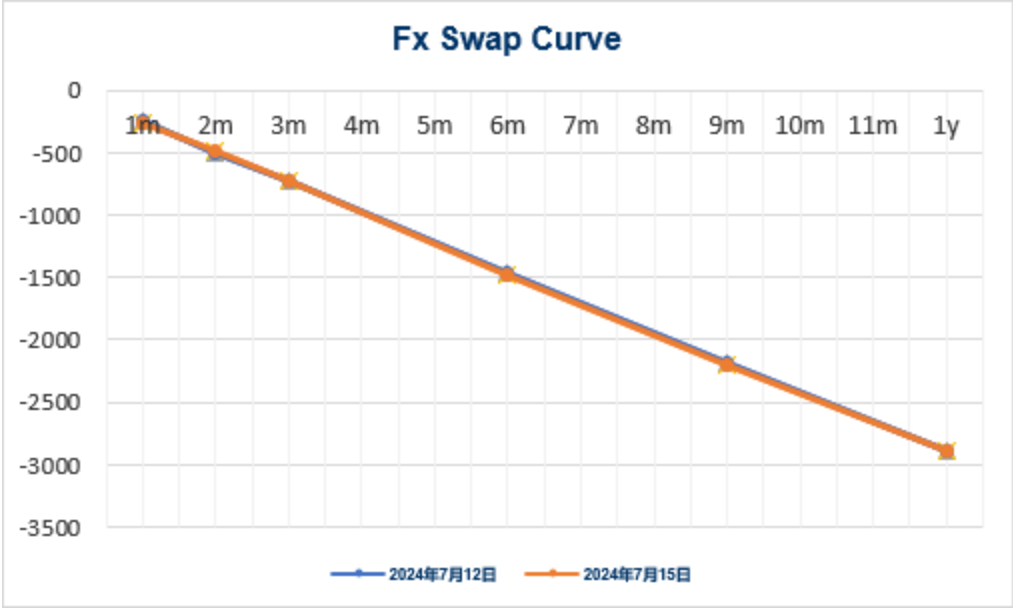
中长期限，6s 成交主要成交 -1477，-1476 的位置；9s 成交在 -2203，-2200，-2198 的位置；1y 今日成交较多，开盘在 -2888 的位置，随后一路走低，较多成交在 -2888，-2906 的位置，尾盘收在 -2900 的位置。

超长期限，18s 成交在 -4060 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -747 的位置；6s*1y 成交在 -1430，-1428 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2574	-0.42
2W	14	-107	7.2520	-212
1M	33	-255	7.2373	-16.6
2M	63	-493	7.2134	5
3M	92	-729	7.1898	-4.9
6M	184	-1473	7.1154	-6
9M	274	-2200	7.0427	-9
1Y	365	-2897	6.9730	-3
18M	552	-4060	6.8567	-10
2Y	730	-4910	6.7717	0
3Y	1097	-6055	6.6572	-30
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1313	
CLOSING SPOT RATE			7.2627	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-238.9	-474.2	-1218.5	-1945.5	-2642.5
2M		-235.3	-979.6	-1706.6	-2403.6
3M			-744.3	-1471.3	-2168.3
6M				-727	-1424
9M					-697



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