



【2024-07-02】

今日 Fixing 定在 7.1291，较上一交易日上调了 26 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 -7.7~-7.2 的位置；T/N 成交在 -14.9~-14.6 的位置；S/N 成交在 -22.56~-22.46 的位置。1w 较多成交在 -52.6，-52.55，-52.5 的位置；2w 成交在 -105.6 的位置；3w 成交在 -158.5 的位置；1s 成交在 -236.5，-236.4 的位置；3s 成交在 -755 的位置；4s 成交在 -988 的位置。

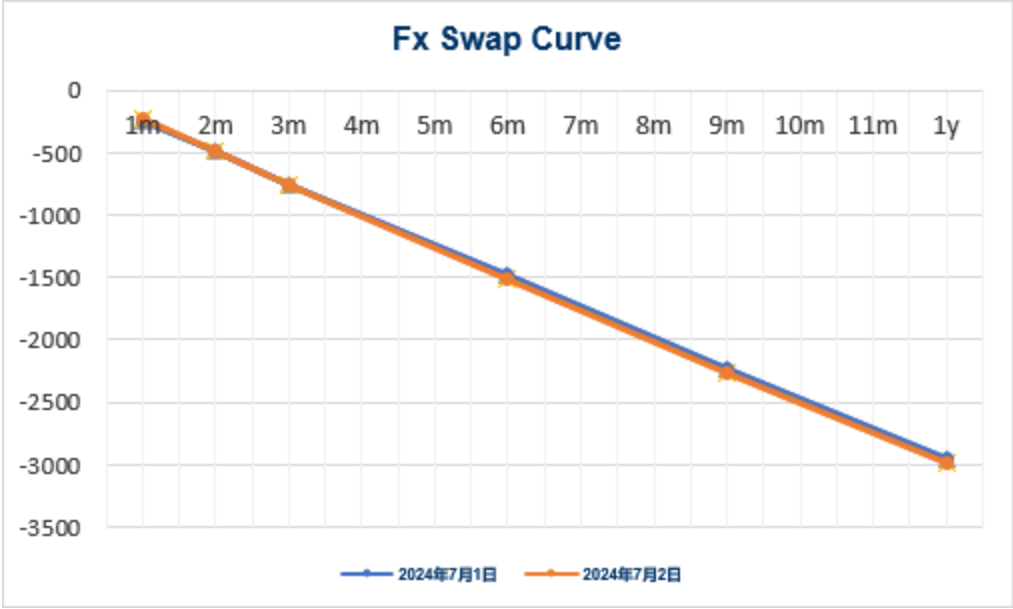
中长期，6s 成交主要成交 -1500，-1498 的位置；9s 成交在 -2261 的位置；1y 成交在 -2980，-2972.5 的位置。

超长期，3y 成交在 -6150 的位置。

Spread 上，2s*3s 成交在 -273 的位置；6s*9s 成交在 -758 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2661	-0.45
2W	14	-106	7.2608	-1
1M	31	-237	7.2477	12.1
2M	62	-483	7.2231	-3
3M	95	-756	7.1959	10.15
6M	185	-1504	7.1211	-18
9M	276	-2262	7.0452	-32
1Y	367	-2985	6.9729	-37
18M	549	-4155	6.8559	-40
2Y	731	-5060	6.7654	-70
3Y	1096	-6185	6.6529	-65
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1291	
CLOSING SPOT RATE			7.2714	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-245.7	-518.6	-1266.6	-2025.1	-2748.1
2M		-272.9	-1020.9	-1779.4	-2502.4
3M			-748	-1506.5	-2229.5
6M				-758.5	-1481.5
9M					-723



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