



【2024-07-31】

今日 Fixing 定在 7.1346，较上一交易日下调了 18 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

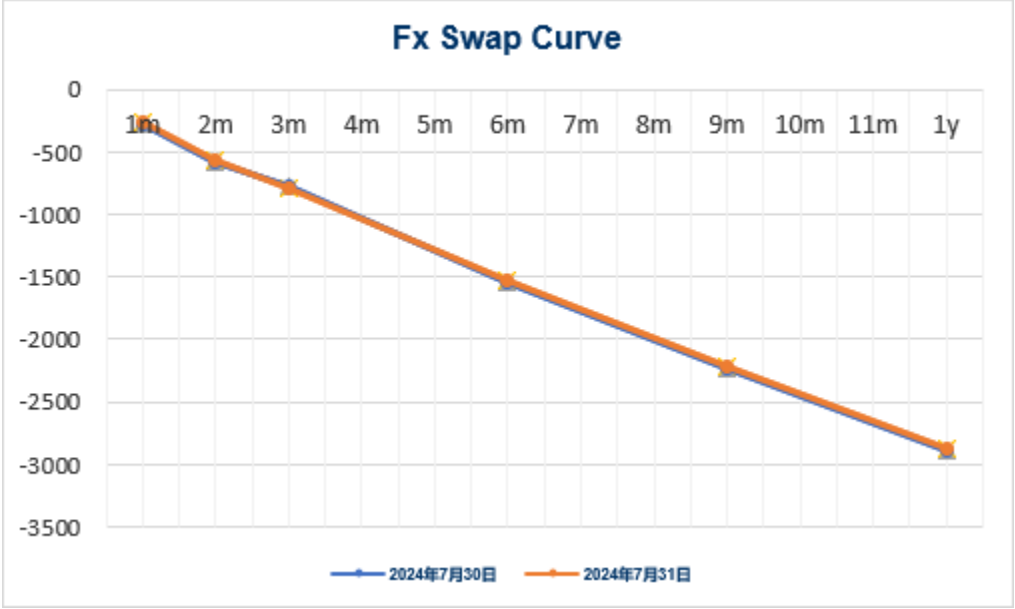
短端，O/N 成交在 -9~-8.2 的位置；T/N 成交在 -9~-8.88 的位置；S/N 成交在 -26.2~-26.15 的位置。1w 成交在 -60.15 的位置；2w 成交在 -117 的位置；1s 成交在 -270.6，-270，-269 的位置；2s 成交在 -568.4 的位置；3s 成交在 -790，-788 的位置；5s 成交在 -1270，-1267 的位置。

中长期，6s 成交在 -1538 的位置；9s 成交在 -2235，-2231，-2225 的位置；1y 成交在 -2894，-2892，-2890 的位置，尾盘收在 -2878 的位置。

Spread，3s*5s 成交在 -482，-480，-479 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-60	7.2201	0.68
2W	14	-117	7.2144	2
1M	32	-266	7.1995	11.15
2M	67	-565	7.1696	9
3M	94	-786	7.1475	-15
6M	186	-1526	7.0735	19
9M	277	-2215	7.0046	25
1Y	367	-2874	6.9387	15
18M	549	-3940	6.8321	30
2Y	731	-4750	6.7511	50
3Y	1095	-5900	6.6361	40
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1346	
CLOSING SPOT RATE			7.2261	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-299.4	-520	-1260	-1949	-2607.8
2M		-220.6	-960.6	-1649.6	-2308.4
3M			-740	-1429	-2087.8
6M				-689	-1347.8
9M					-658.8



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