



【2024-06-11】

今日 Fixing 定在 7.1135，较上一交易日下调了 29 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

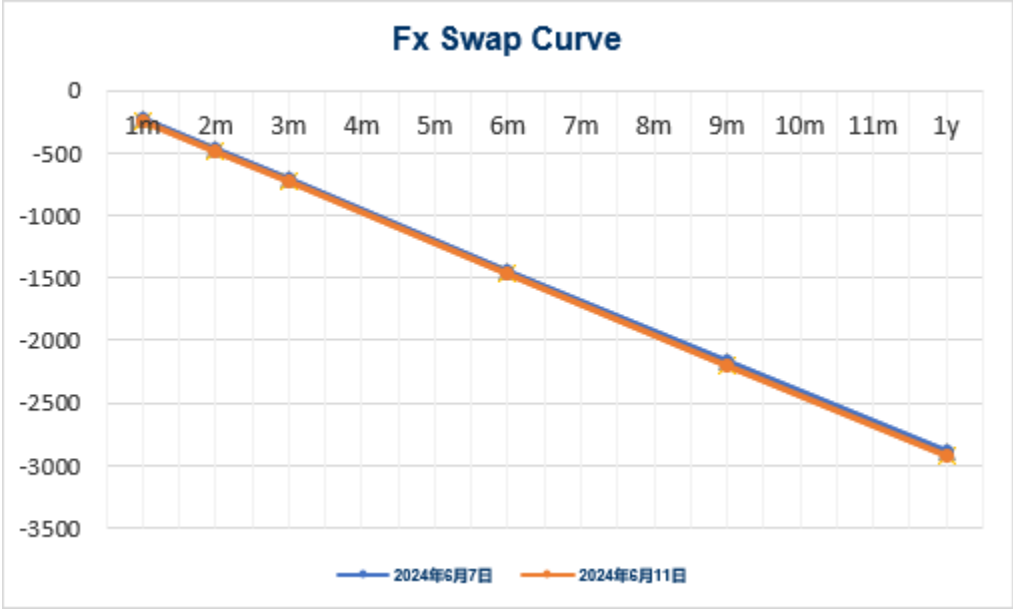
短端，O/N 成交在 -8.3~-8 的位置；T/N 成交在 -8.35~-8 的位置，S/N 成交在 -8.3~-8.12 的位置。1w 较多成交在 -57.3，-56.6 的位置；2w 成交在 -113 的位置；3w 成交在 -175 的位置；1s 主要成交在 -253 的位置；2s 成交在 -480 的位置；3s 成交在 -726，-725 的位置。

中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1479，-1478 的位置；9s 成交在 -2220，-2210 的位置；1y 成交在 -2950 的位置，成交较少。

Spread 上，2s*3s 成交在 -245 的位置；3s*6s 成交在 -753 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-56	7.2485	5.87
2W	14	-111	7.2430	-4
1M	32	-252	7.2289	-21.7
2M	61	-481	7.2061	-11
3M	92	-725	7.1817	-13
6M	183	-1469	7.1073	-21
9M	273	-2206	7.0336	-31.5
1Y	365	-2928	6.9613	-45
18M	550	-4120	6.8421	-100
2Y	732	-4970	6.7571	-80
3Y	1096	-6070	6.6471	-95
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1135	
CLOSING SPOT RATE			7.2541	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-228.4	-472.4	-1216.4	-1953.4	-2675.9
2M		-244	-988	-1725	-2447.5
3M			-744	-1481	-2203.5
6M				-737	-1459.5
9M					-722.5



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