



【2024-05-13】

今日 Fixing 定在 7.103，较上一交易日下调了 19 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 -7.35~-6.8 的位置，T/N 成交在 -7.21~-7.13 的位置，S/N 成交在 -7.2~-7.15 的位置。1w 今日成交在 -50.3~-50.29 的位置，成交寥寥；1s 今日成交较少，成交在 -240 的位置；2s 成交在 -453 的位置；3s 开盘在 -688 的位置，随后价格回落到 -690.5 的位置，成交较少。

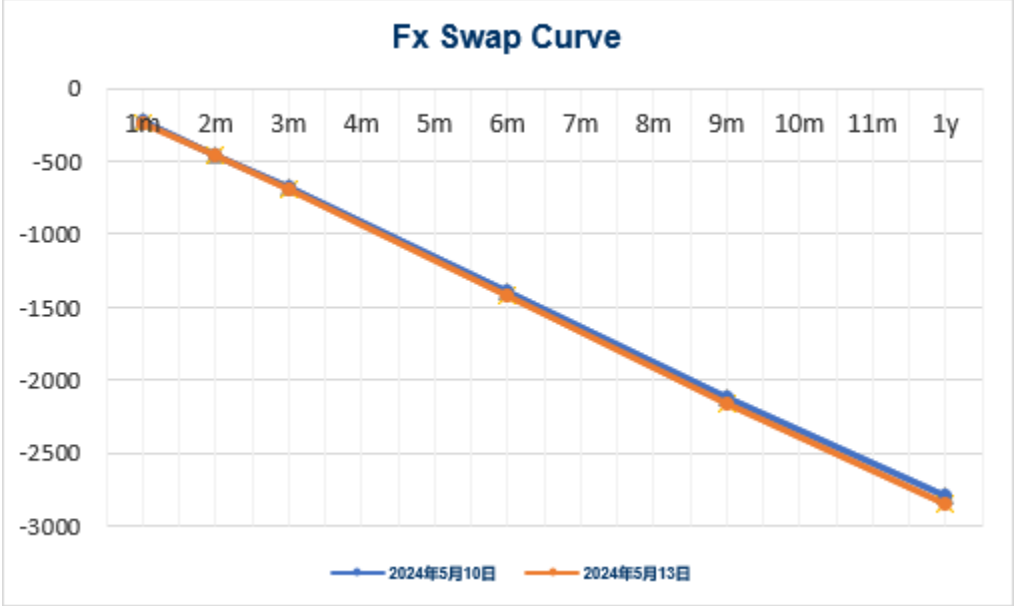
中长期，6s 成交较少，成交价格在 -1415 附近位置；9s 成交较多，开盘在 -2170 的位置，随后在 -2168~-2167 之间来回成交，最后成交在 -2168 位置；1y 成交较为活跃，开盘在 -2838 的位置，最后一路买至 -2830 处，尾盘开始回落，最后收盘在 -2850 的位置。

超长期限，2y 有部分成交，位置在 -4820，-4815，-4800。

Spread 上，6s*9s 成交在 -752，-750 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2297	-0.93
2W	14	-99	7.2248	0
1M	31	-241	7.2106	-17.72
2M	62	-453	7.1894	2
3M	92	-692	7.1655	-9.7
6M	184	-1420	7.0927	-24
9M	276	-2162	7.0185	-47
1Y	365	-2845	6.9502	-51
18M	549	-3910	6.8437	0
2Y	730	-4850	6.7497	-100
3Y	1095	-5850	6.6497	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1030	
CLOSING SPOT RATE			7.2347	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-212.18	-451.38	-1179.18	-1921.18	-2604.18
2M		-239.2	-967	-1709	-2392
3M			-727.8	-1469.8	-2152.8
6M				-742	-1425
9M					-683



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