



【2024-05-20】

今日 Fixing 定在 7.1042，较上一交易日下调了 3 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

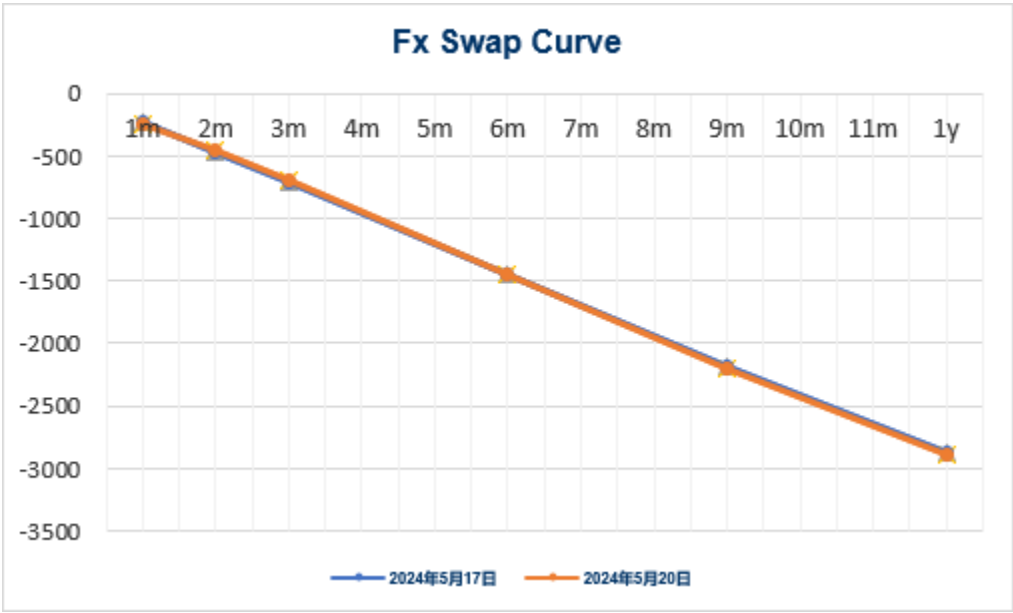
短端，O/N 成交在 -7.2~-6.6 的位置，T/N 成交在 -7.3~-7.05 的位置，S/N 成交在 -7.31~-7.15 的位置。1w 今日开盘在 -50.7 位置，随后一路走高，最低成交在 -50.65 的位置；2w 今日成交较少，在 -102 的位置；1s 今日成交较少，反复成交在 -243.5 的位置；2s 成交在 -457 的位置；3s 成交较少，主要成交在 -702 的位置。

中长期，6s 成交较少，成交价格在 -1447，-1446 附近位置；9s 成交在 -2200，-2195 的位置，成交寥寥；1y 成交较为活跃，开盘在 -2881 的位置，随后一路下跌，最低在 -2895 的位置。

超长期限，2y 有部分成交，位置在 -4870，-4850 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.2269	1.23
2W	14	-102	7.2218	2
1M	31	-244	7.2077	-11.5
2M	62	-458	7.1863	13
3M	92	-701	7.1619	4.8
6M	184	-1446	7.0874	1
9M	276	-2207	7.0113	-24
1Y	365	-2884	6.9436	-12
18M	549	-4005	6.8315	0
2Y	730	-4870	6.7450	20
3Y	1095	-5900	6.6420	20
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1042	
CLOSING SPOT RATE			7.2320	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-214	-457.7	-1202.5	-1963.5	-2640.5
2M		-243.7	-988.5	-1749.5	-2426.5
3M			-744.8	-1505.8	-2182.8
6M				-761	-1438
9M					-677



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