



【2024-05-14】

今日 Fixing 定在 7.1053，较上一交易日下调了 23 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 -8~-7.15 的位置，T/N 成交在 -7.28~-7.15 的位置，S/N 成交在 -7.27~-7.19 的位置。1w 今日成交在 -50.75~-50.7 的位置，成交寥寥；1s 今日成交较少，成交在 -235 的位置；2s 成交在 -457 的位置；3s 开盘在 -692 的位置，随后价格回落到 -702 的位置，成交较少。

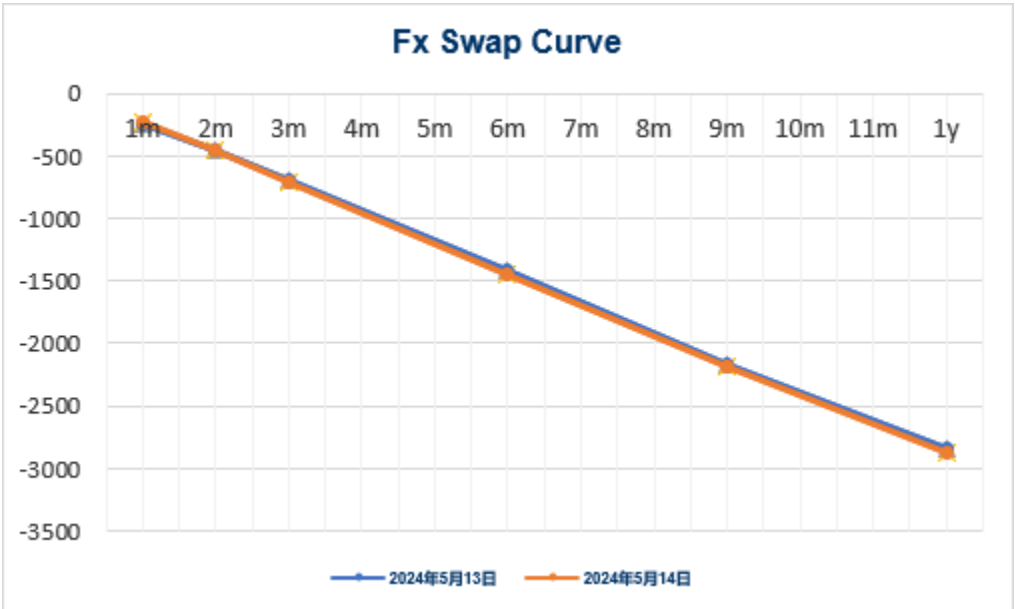
中长期，6s 成交较少，成交价格在 -1449 附近位置；9s 成交在 -2178 的位置，尾盘有小量成交在 -2188 的位置；1y 成交较为活跃，开盘在 -2874 的位置，最后回落至 -2880 处，尾盘又被买上去，最后收盘在 -2871 的位置。

超长期限，2y 有部分成交，位置在 -4890。

Spread 上，6s*1y 成交在 -1425，-1422，-1420 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.2326	-0.45
2W	14	-102	7.2275	-3
1M	31	-236	7.2142	5.32
2M	62	-458	7.1919	-5
3M	92	-703	7.1674	-11.2
6M	184	-1447	7.0930	-27
9M	276	-2185	7.0192	-23
1Y	365	-2874	6.9503	-29
18M	549	-4050	6.8327	-140
2Y	730	-4900	6.7477	-50
3Y	1095	-6000	6.6377	-150
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1053	
CLOSING SPOT RATE			7.2377	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-222.2	-467.9	-1211.5	-1949.5	-2638.5
2M		-245.7	-989.3	-1727.3	-2416.3
3M			-743.6	-1481.6	-2170.6
6M				-738	-1427
9M					-689



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