



【2024-06-28】

今日 Fixing 定在 7.1268，较上一交易日上调了 2 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

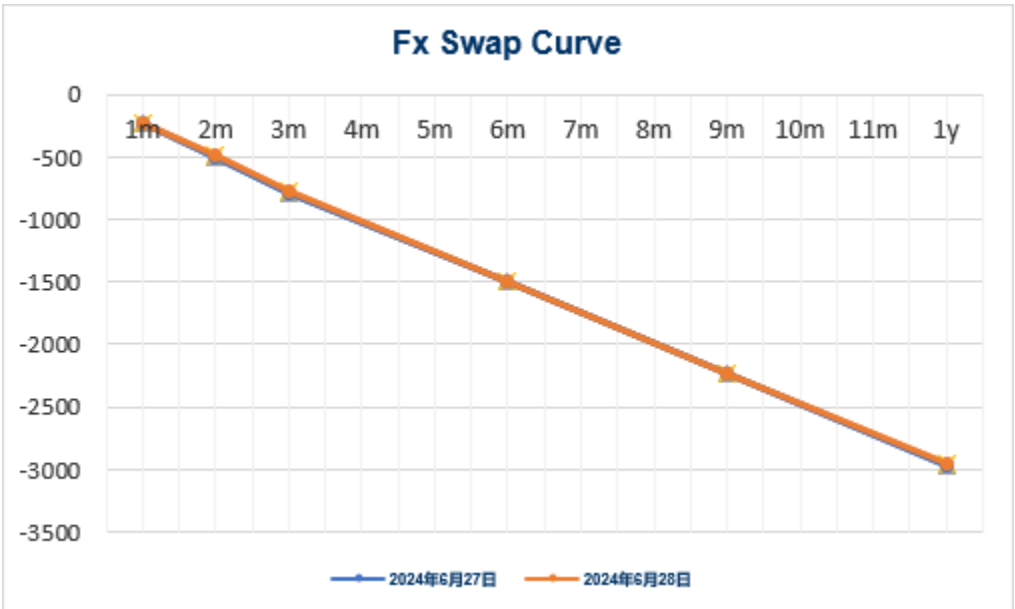
短端，O/N 成交在 -21~-18.5 的位置；T/N 成交在 -7.23~-6.82 的位置；S/N 成交在 -7.3~-7.25 的位置。1w 较多成交在 -51.8，-51.7 的位置；2w 成交在 -106.5，-104.5，-104 的位置；1s 成交在 -232.5，-232.4，-232 的位置；3s 成交在 -775，-774 的位置。

中长期，6s 成交主要成交 -1489，-1488 的位置；9s 成交在 -2237 的位置；1y 成交在 -2963，-2962，-2960，-2959，-2956 的位置。

Spread 上，1w*1s 成交在 -180.5 的位置；2w*1s 成交在 -128，-127.5 的位置

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2607	0.25
2W	14	-104	7.2555	1
1M	31	-232	7.2427	3.5
2M	63	-487	7.2172	11
3M	98	-775	7.1884	10
6M	184	-1490	7.1169	10
9M	274	-2239	7.0420	-2
1Y	365	-2962	6.9698	2
18M	552	-4150	6.8509	0
2Y	730	-5020	6.7639	-30
3Y	1095	-6065	6.6594	-5
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1268	
CLOSING SPOT RATE			7.2659	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-255	-543	-1258	-2007	-2729.5
2M		-288	-1003	-1752	-2474.5
3M			-715	-1464	-2186.5
6M				-749	-1471.5
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