



【2024-05-16】

今日 Fixing 定在 7.1020，较上一交易日上调了 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 -9.2~-8.22 的位置，T/N 成交在 -22.8~-22.1 的位置，S/N 成交在 -7.38~-7.36 的位置。1w 今日开盘在 -58.6 位置，随后一路走低，最低成交在 -59 的位置；2w 今日有少量成交，价格在 -103.3 的位置；1s 今日成交较少，反复成交在 -232 的位置，最低成交在 -232.5 的位置；2s 成交在 -476 的位置；3s 成交较少，主要成交在 -699 的位置。

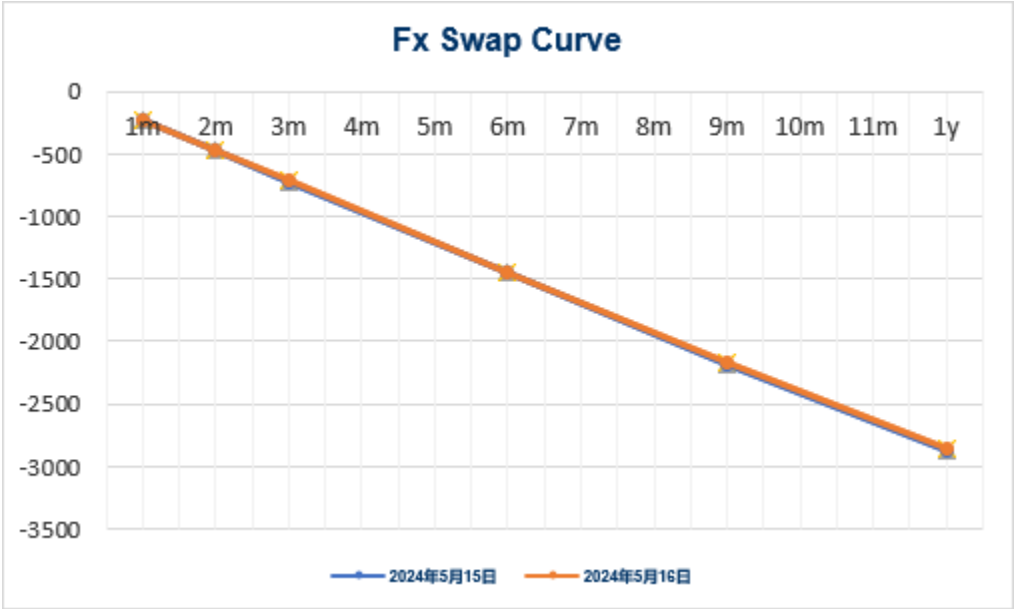
中长期限，6s 成交较少，成交价格在 -1430，-1420 附近位置；9s 成交在 -2175 的位置，成交寥寥；1y 成交较为活跃，开盘在 -2835 的位置，随后一路下跌，最后回落至 -2865 处，尾盘回升至 -2861 的位置。

超长期限，18s 有部分成交，位置在 -3980 的位置。

Spread 上，6s*1y 成交在 -1403 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-59	7.2129	-7.3
2W	14	-104	7.2084	0
1M	31	-233	7.1956	-0.5
2M	62	-476	7.1712	-14
3M	92	-705	7.1483	13.8
6M	184	-1446	7.0742	2
9M	276	-2175	7.0013	6
1Y	365	-2862	6.9326	18
18M	549	-4010	6.8178	25
2Y	730	-4825	6.7363	45
3Y	1095	-6000	6.6188	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1020	
CLOSING SPOT RATE			7.2188	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-243.96	-472.5	-1213.5	-1942.5	-2629.5
2M		-228.54	-969.54	-1698.54	-2385.54
3M			-741	-1470	-2157
6M				-729	-1416
9M					-687



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