



【2024-06-07】

今日 Fixing 定在 7.1106，较上一交易日下调了 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。

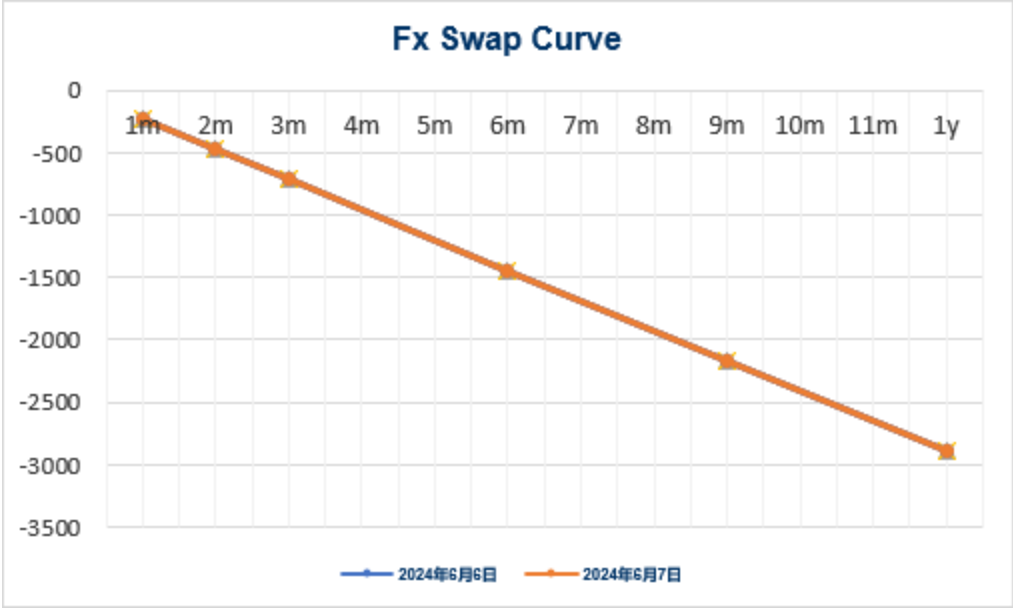
短端，O/N 成交在 -33.7~-32.8 的位置；T/N 成交在 -7.99~-7.6 的位置，S/N 成交在 -7.97~-7.95 的位置。1w 较多成交在 -61.7 的位置；1s 主要成交在 -230.9，-230.8 的位置；2s 成交在 -470，-469.9，-469 的位置；3s 成交在 -712.5，-712，-709 的位置；4s 成交在 -976，-974 的位置。

中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1450，-1449 的位置；9s 成交在 -2178，-2175 的位置；1y 成交较为活跃，开盘在 -2895 的位置，大量成交在 -2890，-2888 的位置。

Spread 上，1s*3s 成交在 -480.5 的位置；3s*4s 成交在 -264 的位置；3w*1s 成交在 -69.8 的位置；9s*1y 成交在 -714，-710 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-62	7.2364	-9.07
2W	14	-107	7.2319	-2
1M	30	-230	7.2196	-2.3
2M	61	-470	7.1956	4
3M	92	-712	7.1715	-4.5
6M	183	-1448	7.0979	-1
9M	273	-2174	7.0252	0
1Y	365	-2883	6.9543	7
18M	548	-4020	6.8406	20
2Y	730	-4890	6.7536	20
3Y	1097	-5975	6.6451	-55
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1106	
CLOSING SPOT RATE			7.2426	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-239.3	-481.1	-1217.1	-1943.6	-2652.6
2M		-241.8	-977.8	-1704.3	-2413.3
3M			-736	-1462.5	-2171.5
6M				-726.5	-1435.5
9M					-709



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