



【2024-06-24】

今日 Fixing 定在 7.1201，较上一交易日下调了 5 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 -7.2~-7 的位置；T/N 成交在 -7.28~-6.86 的位置；S/N 成交在 -7.44~-7.2 的位置。1w 较多成交在 -53.6，-53.55，-53 的位置；2w 成交在 -107.5 的位置；1s 成交在 -231.5，-231，-230.8 的位置；2s 成交在 -479 的位置；3s 成交在 -732.5，-732，-731.5 的位置。

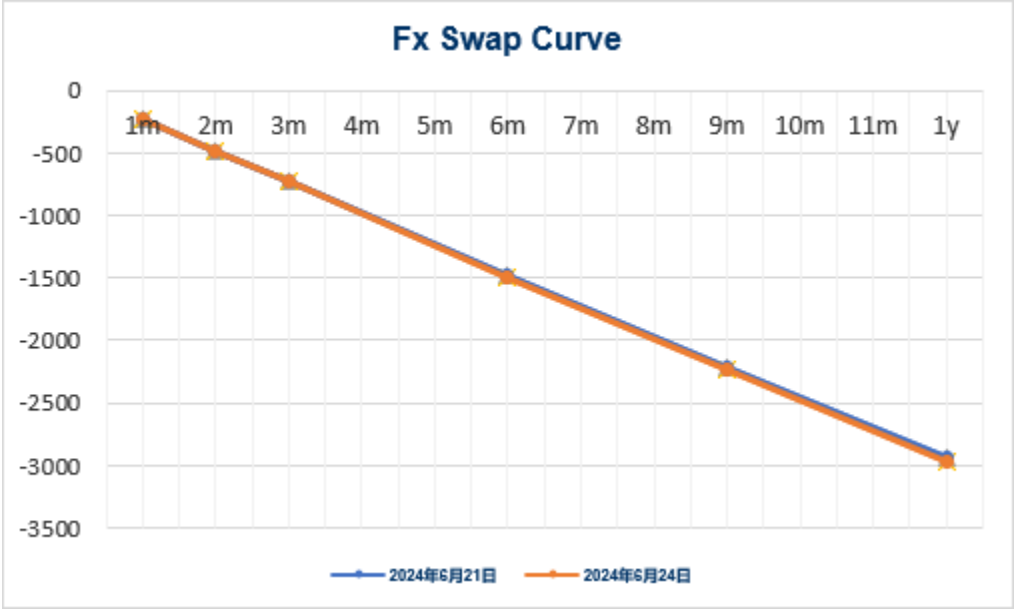
中长期，6s 成交较少，主要成交在 -1488，-1485 的位置；9s 成交在 -2235，-2228 的位置；1y 成交在 -2959，-2957，-2956，-2950，-2949，-2945 的位置。

超长期限，18s 成交在 -4100，-4090，-4085 的位置；2y 成交在 -4970 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -53.75 的位置；2s*3s 成交在 -254 的位置；6s*1y 成交在 -1467 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2565	-0.95
2W	14	-108	7.2511	0
1M	30	-231	7.2387	0.2
2M	61	-479	7.2139	7
3M	92	-733	7.1885	-5
6M	183	-1491	7.1127	-8
9M	273	-2236	7.0382	-20
1Y	365	-2965	6.9653	-32
18M	548	-4105	6.8513	-15
2Y	730	-4990	6.7628	-35
3Y	1097	-6000	6.6618	25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1201	
CLOSING SPOT RATE			7.2618	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-247.9	-501.9	-1259.9	-2004.9	-2733.9
2M		-254	-1012	-1757	-2486
3M			-758	-1503	-2232
6M				-745	-1474
9M					-729



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