



【2024-06-12】

今日 Fixing 定在 7.1133，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 -7.96~-7.65 的位置；T/N 成交在 -7.88~-7.47 的位置，S/N 成交在 -23.6~-23.05 的位置。1w 较多成交在 -55.5，-54.2，-53.8 的位置；2w 成交在 -110 的位置；3w 成交在 -163 的位置；1s 主要成交在 -242 的位置；2s 成交在 -475 的位置。

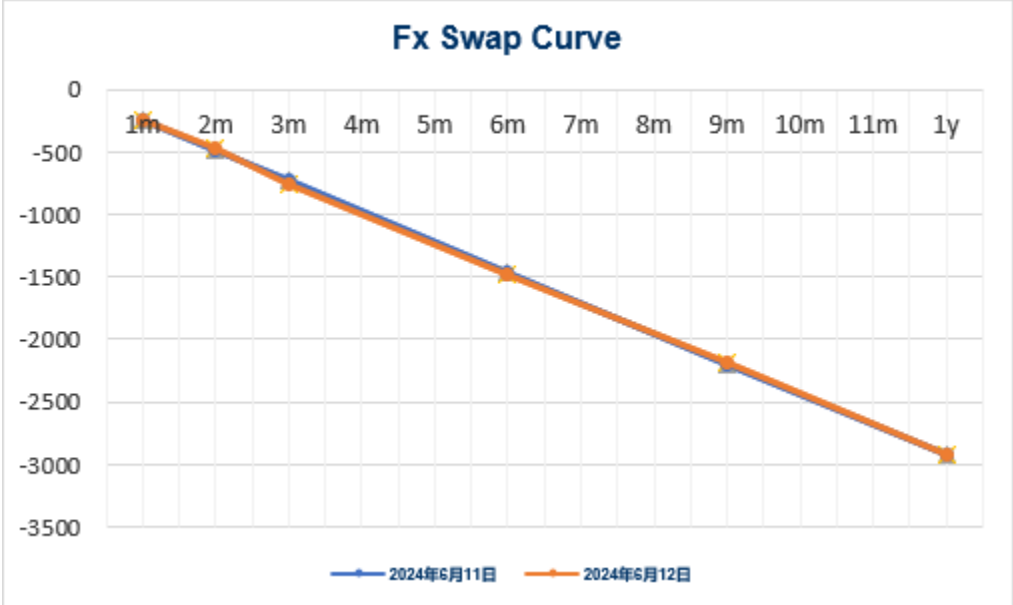
中长期，6s 成交较少，主要成交在 -1476，-1475 的位置；9s 成交在 -2195，-2190 的位置；1y 成交在 -2920，-2918，-2916，-2910 的位置。

超长期限，2y 成交在 -4910 的位置；3y 成交在 -5970，-5960 的位置。

Spread 上，2s*3s 成交在 -277 的位置；6s*1y 成交在 -1442，-1438 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-54	7.2483	2.15
2W	14	-107	7.2430	4
1M	31	-241	7.2296	10.7
2M	61	-476	7.2062	5
3M	96	-752	7.1785	-27.3
6M	185	-1477	7.1060	-9
9M	273	-2192	7.0345	13.5
1Y	367	-2921	6.9616	7
18M	549	-4060	6.8477	60
2Y	731	-4910	6.7627	60
3Y	1095	-6005	6.6532	65
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1133	
CLOSING SPOT RATE			7.2537	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-234.1	-510.4	-1235.6	-1950.6	-2679.6
2M		-276.3	-1001.5	-1716.5	-2445.5
3M			-725.2	-1440.2	-2169.2
6M				-715	-1444
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