



【2024-06-05】

今日 Fixing 定在 7.1097，较上一交易日上调了 14 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

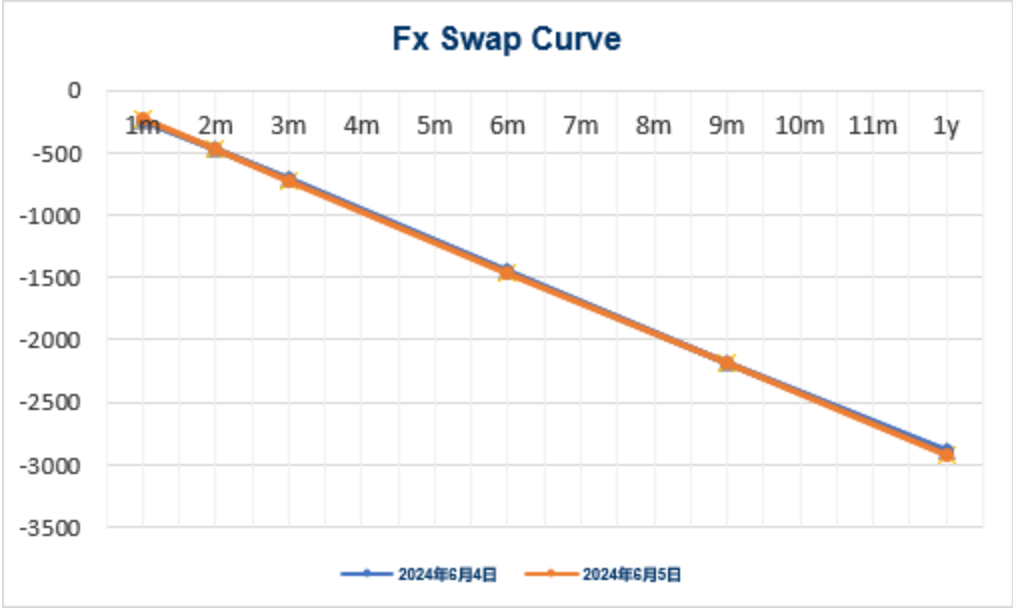
短端，O/N 成交在 -7.45~-7.2 的位置；T/N 成交在 -7.5~-7.48 的位置，S/N 成交在 -30.1~-29.8 的位置。1w 成交较多，开盘在 -52.7 的位置，较多成交在 -52.36 的位置。3w 成交在 -157 的位置；1s 成交较多，主要成交在 -234，-233.8 的位置；2s 成交在 -462 的位置；3s 成交在 -720，-719 的位置。

中长期，6s 成交较少，主要成交在 -1462，-1453 的位置；9s 成交在 -2177，-2173 的位置；1y 成交较为活跃，开盘在 -2900 的位置，大量成交在 -2912，-2903 的位置。

Spread 上，1s*2s 成交在 -228 的位置；3w*1s 成交在 -77 的位置；6s*9s 成交在 -716 的位置；6s*1y 成交在 -1448，-1447 的位置；3s*6s 成交在 -741 的位置；1y*2y 成交在 -2007 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2413	-0.08
2W	14	-105	7.2360	0
1M	32	-234	7.2231	5.7
2M	61	-462	7.2003	-1
3M	92	-719	7.1746	-16.1
6M	183	-1462	7.1003	-21
9M	273	-2178	7.0287	0
1Y	365	-2918	6.9547	-23
18M	550	-4060	6.8405	5
2Y	732	-4890	6.7575	35
3Y	1096	-5995	6.6470	-15
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1097	
CLOSING SPOT RATE			7.2465	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-228.3	-485.2	-1227.9	-1943.9	-2683.9
2M		-256.9	-999.6	-1715.6	-2455.6
3M			-742.7	-1458.7	-2198.7
6M				-716	-1456
9M					-740



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