



【2024-06-06】

今日 Fixing 定在 7.1108，较上一交易日上调了 11 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

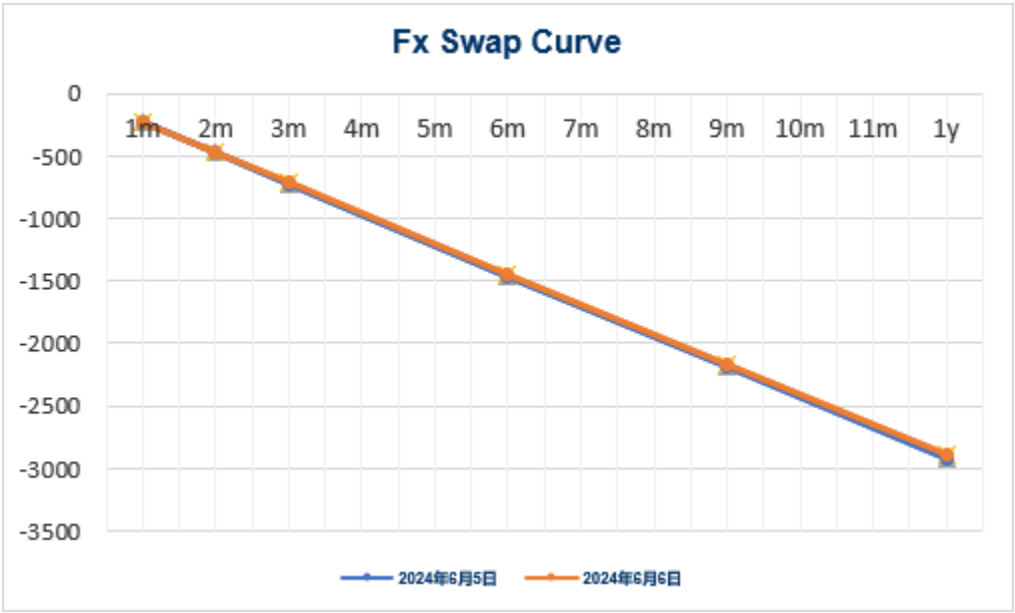
短端，O/N 成交在 -10~-7.4 的位置；T/N 成交在 -31.58~-29.6 的位置，S/N 成交在 -7.59~-7.46 的位置。1w 较多成交在 -52.3 的位置；1s 主要成交在 -226.7，-226.5 的位置；3s 成交在 -707.3，-705 的位置；5s 成交在 -1206，-1205 的位置。

中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1446，-1445，-1441 的位置；9s 成交在 -2173，-2160 的位置；1y 成交较为活跃，开盘在 -2882.5 的位置，大量成交在 -2888，-2880 的位置。

Spread 上，1s*2s 成交在 -243.5 的位置；6s*9s 成交在 -727 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2420	-0.32
2W	14	-105	7.2368	-1
1M	32	-228	7.2245	6
2M	61	-473	7.2000	-11
3M	92	-707	7.1766	12.3
6M	183	-1447	7.1026	15
9M	273	-2174	7.0299	4
1Y	365	-2890	6.9583	28
18M	550	-4040	6.8433	20
2Y	732	-4910	6.7563	-20
3Y	1096	-5920	6.6553	75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1108	
CLOSING SPOT RATE			7.2473	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-245.1	-478.9	-1218.9	-1945.9	-2661.9
2M		-233.8	-973.8	-1700.8	-2416.8
3M			-740	-1467	-2183
6M				-727	-1443
9M					-716



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