



【2024-06-04】

今日 Fixing 定在 7.1083，较上一交易日下调了 3 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

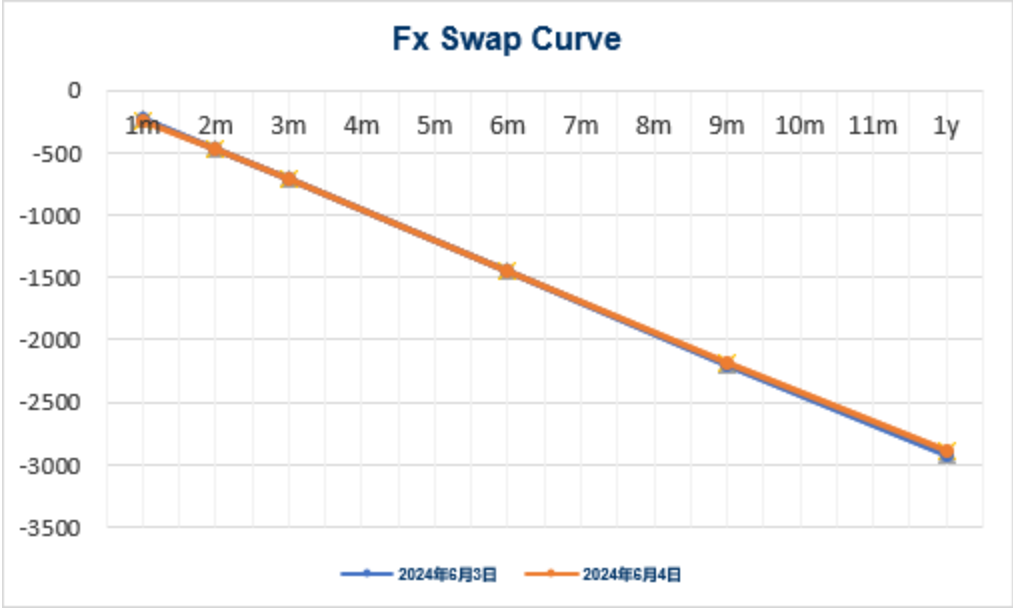
短端，O/N 成交在 -7.9~-7. 4 的位置；T/N 成交在 -7.54~-7.33 的位置，S/N 成交在 -7.5~-7.4 的位置。1w 成交较多，开盘在 -52.05 的位置，较多成交在 -52.05，-52.04 的位置，尾盘在 -552.2 位置。1s 成交较多，主要成交在 -239.6，-239，-238.9 的位置；3s 成交在 -704 的位置；4s 成交在 -962 的位置。

中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1445，-1444 的位置；9s 成交在 -2180 的位置；1y 成交较为活跃，开盘在 -2900 的位置，大量成交在 -2903，-2897 的位置。

Spread 上，1s*3s 成交在 -465 的位置；9s*1y 成交在 -720.5 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2392	-0.9
2W	14	-105	7.2339	5
1M	32	-240	7.2204	-17
2M	61	-462	7.1983	1
3M	92	-703	7.1741	2.8
6M	183	-1441	7.1003	9
9M	273	-2178	7.0266	17
1Y	365	-2895	6.9549	32
18M	550	-4065	6.8379	35
2Y	732	-4925	6.7519	65
3Y	1096	-5980	6.6464	120
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1083	
CLOSING SPOT RATE			7.2444	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-221.7	-463.4	-1201.2	-1938.2	-2655.2
2M		-241.7	-979.5	-1716.5	-2433.5
3M			-737.8	-1474.8	-2191.8
6M				-737	-1454
9M					-717



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