



【2024-05-23】

今日 Fixing 定在 7.1098，较上一交易日上调了 21 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 -7.2~-6.9 的位置，T/N 成交在 -28.3~-28.05 的位置，S/N 成交在 -7.29~-7.27 的位置。1w 今日开盘在 -51 位置，随后一路下跌，最低在 -51.35 的位置；1s 今日成交较少，开盘在 -230 的位置，最后成交在 -230.8 的位置；2s 成交在 -468 的位置；3s 成交较少，主要成交在 -704.5 的位置，尾盘收在 -703 的位置；5s 今日有少许成交在 -1203 的位置。

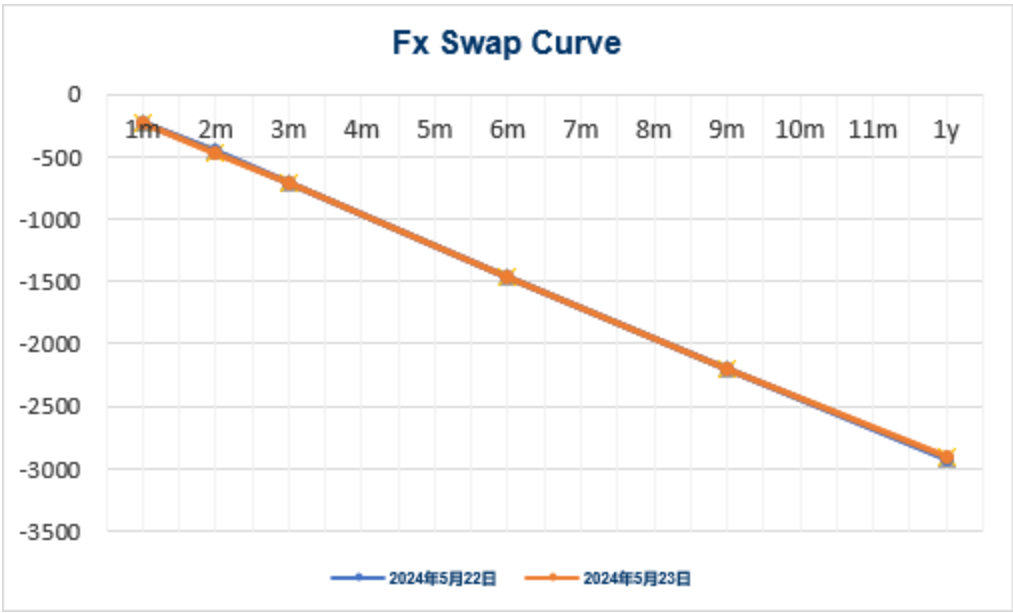
中长期限，6s 开盘在 -1471.5 的位置，较多成交在 -1468 的位置，最后收在 -1463 的位置；9s 成交在 -2225 的位置，成交寥寥；1y 成交较为活跃，开盘在 -2914 的位置，盘中一路走低，午盘后开始回升，尾盘有部分成交在 -2918 的位置。

超长期限，2y 成交在 -4920 的位置；3y 成交在 -6000，-5980 的位置。

Spread 上，1w*1s 成交在 -179 的位置；2w*1s 成交在 -127.5 的位置；3s*6s 成交在 -761 的位置；6s*9s 成交在 -757 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.2395	-1.4
2W	14	-102	7.2344	0
1M	31	-231	7.2216	-2.7
2M	62	-468	7.1978	-12
3M	92	-703	7.1743	9.88
6M	184	-1462	7.0984	-7
9M	276	-2208	7.0238	-6
1Y	365	-2908	6.9538	11
18M	549	-4060	6.8386	-10
2Y	730	-4950	6.7496	-40
3Y	1095	-5900	6.6546	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1098	
CLOSING SPOT RATE			7.2446	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-237.5	-472.5	-1231.5	-1977.5	-2677.5
2M		-235	-994	-1740	-2440
3M			-759	-1505	-2205
6M				-746	-1446
9M					-700



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报及更多资讯



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