



【2024-06-25】

今日 Fixing 定在 7.1225，较上一交易日下调了 24 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 -8~-6.8 的位置；T/N 成交在 -7.4~-6.8 的位置；S/N 成交在 -7.3~-7.2 的位置。1w 较多成交在 -60.5，-60，-59.8 的位置；2w 成交在 -106.5，-106 的位置；1s 成交在 -246.5 的位置；2s 成交在 -480 的位置；3s 成交在 -734.5，-730.5 的位置。

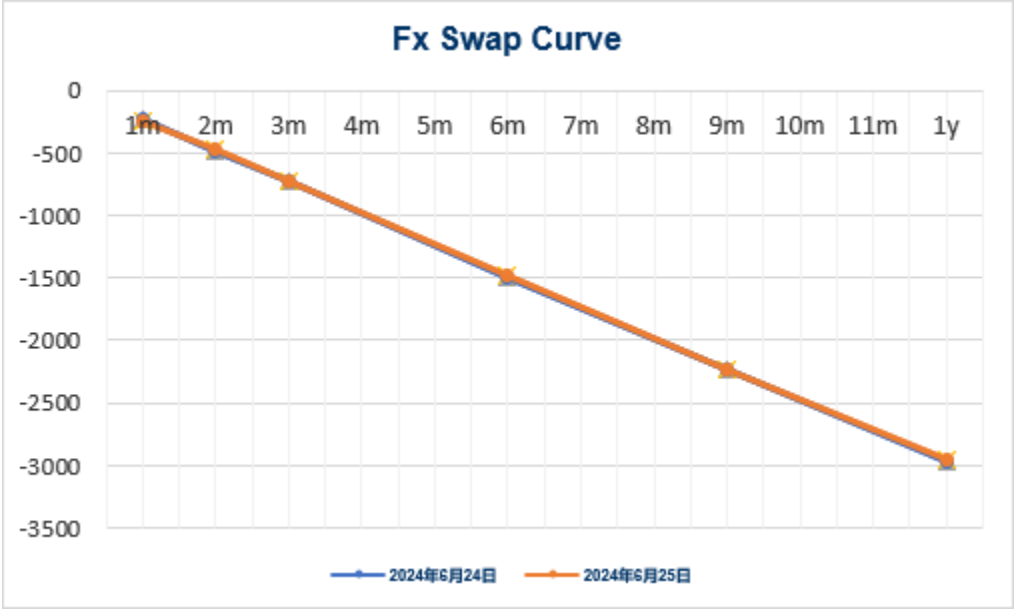
中长期，6s 成交主要成交 -1491，-1490，-1489，-1488，-1487，-1482 的位置；9s 成交在 -2234，-2232 的位置；1y 成交在 -2966，-2965，-2963，-2960，-2958，-2957 的位置。

超长期限，18s 成交在 -4100 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -759.5 的位置；2s*3s 成交在 -252 的位置；6s*1y 成交在 -1478，-1477，-1476 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-60	7.2568	-6.35
2W	14	-106	7.2522	2
1M	32	-246	7.2383	-14.4
2M	61	-477	7.2151	2
3M	92	-729	7.1899	4
6M	183	-1486	7.1143	6
9M	273	-2234	7.0394	2
1Y	365	-2959	6.9669	6
18M	550	-4120	6.8508	-15
2Y	732	-5010	6.7618	-20
3Y	1096	-6075	6.6553	-75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1225	
CLOSING SPOT RATE			7.2628	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-231.5	-483.5	-1240	-1988.5	-2713.5
2M		-252	-1008.5	-1757	-2482
3M			-756.5	-1505	-2230
6M				-748.5	-1473.5
9M					-725



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