



【2024-05-07】

今日 Fixing 定在 7.1002，较上一交易日下调了 8 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

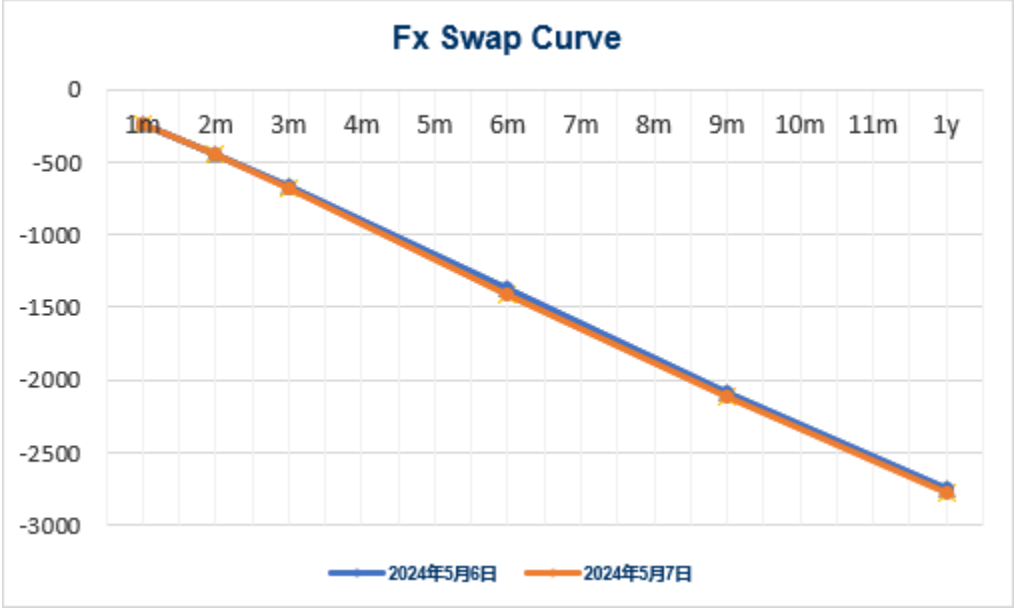
短端，O/N 成交在 -6.6~-5.5 的位置，T/N 成交在 -7.02~-6.72 的位置，S/N 成交在 -6.86~-6.84 的位置。1w 成交在 -49， -48.5 的位置；1s 成交在 -236， -235.3， -235 的位置；3s 成交在 -674， -673.5 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1410， -1408， -1407， -1406.3， -1405， -1404 的位置；9s 成交在 -2118， -2116， -2114， -2112， -2111， -2110 的位置；1y 反复成交在 -2788， -2781， -2780， -2772， -2771 的位置。

Spread 上，2s*3s 成交在 -231， -230 的位置；3s*4s 成交在 -234 的位置；2s*4s 成交在 -465 的位置；6s*9s 成交在 -708， -706.5 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.2098	1.3
2W	14	-98	7.2049	1
1M	33	-236	7.1911	8.1
2M	61	-444	7.1703	0
3M	92	-674	7.1473	-2.2
6M	187	-1406	7.0741	-33
9M	277	-2111	7.0036	-19
1Y	365	-2781	6.9366	-28
18M	550	-3950	6.8197	-75
2Y	732	-4755	6.7392	-55
3Y	1096	-5875	6.6272	25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1002	
CLOSING SPOT RATE			7.2147	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-207.8	-438.3	-1170.1	-1875.1	-2545.1
2M		-230.5	-962.3	-1667.3	-2337.3
3M			-731.8	-1436.8	-2106.8
6M				-705	-1375
9M					-670



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