



【2024-05-28】

今日 Fixing 定在 7.1101，较上一交易日下调了 10 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

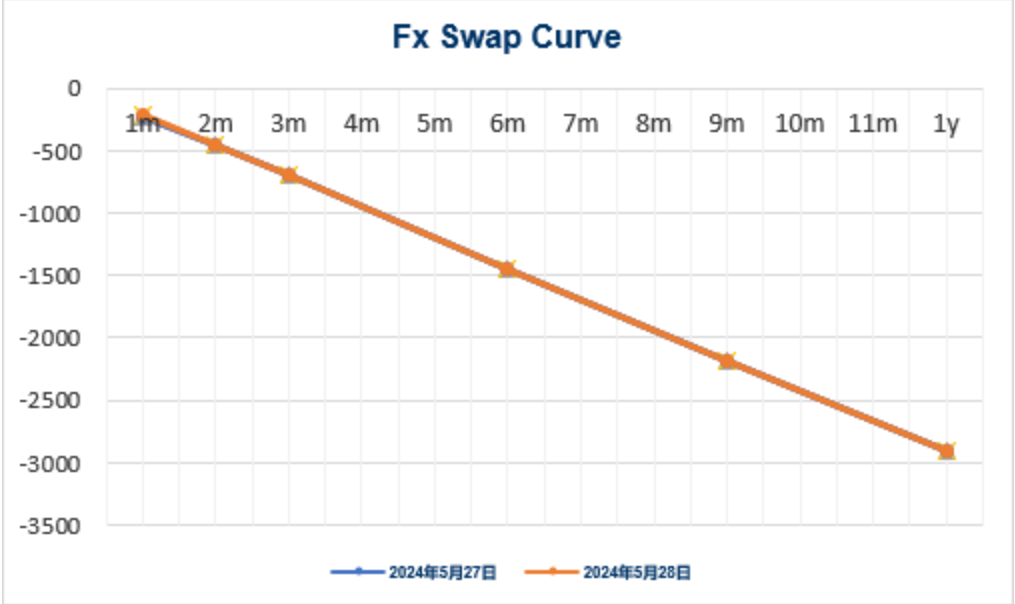
短端，O/N 成交在 -7.15~-6.85 的位置；T/N 成交在 -7.28~-7.16 的位置，S/N 成交在 -7.28~-7.13 的位置。1w 今日成交较为活跃，开盘在 -51 位置，后来大量成交在 -50.95 的位置；1s 今日成交较少，在 -213.5 的位置；3s 开盘在 -700 的位置，成交较少；。

中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1441 的位置；9s 开盘在 -2182 的位置，随后走高，尾盘回落，最后成交在 -2184 的位置；1y 成交较少，有部分成交在 -2895 的位置。

Spread 上，6s*9s 成交在 -741.5，-741 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.2419	0.05
2W	14	-102	7.2368	0
1M	29	-214	7.2257	7.7
2M	61	-458	7.2012	-1
3M	92	-701	7.1769	-1.8
6M	183	-1442	7.1028	3
9M	274	-2186	7.0285	2.5
1Y	365	-2904	6.9566	-4
18M	547	-4066	6.8404	14
2Y	729	-4956	6.7514	9
3Y	1093	-6050	6.6420	-40
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1101	
CLOSING SPOT RATE			7.2470	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-244.5	-487.3	-1228.5	-1972	-2690.5
2M		-242.8	-984	-1727.5	-2446
3M			-741.2	-1484.7	-2203.2
6M				-743.5	-1462
9M					-718.5



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