



【2024-05-27】

今日 Fixing 定在 7.1091，较上一交易日上调了 11 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

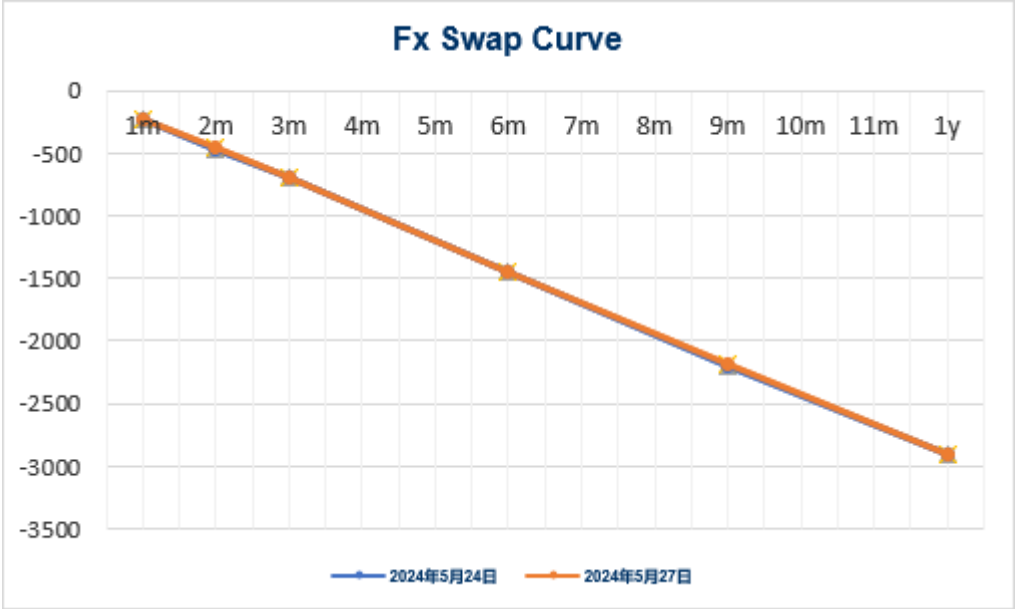
短端，T/N 成交在 -7.25~-7 的位置，S/N 成交在 -7.28~-7.2 的位置。1w 今日成交在 -51 位置；2w 有部分成交在 -102.4 的位置；1s 今日成交较少，在 -221 的位置；3s 开盘在 -701 的位置，成交较少，尾盘成交在 -700 的位置；。

中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1446 的位置；9s 开盘在 -2188 的位置，随后走高，尾盘回落，最后成交在 -2190 的位置；1y 成交较为活跃，开盘在 -2904 的位置，盘中一路走高到 -2898 的位置，尾盘有部分成交在 -2909 的位置。

Spread 上，2w*1s 成交在 -118.6 的位置；3s*6s 成交在 -747 的位置；6s*9s 成交在 -743，-741.5 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.2395	0.75
2W	14	-102	7.2344	2
1M	30	-221	7.2225	9.4
2M	61	-457	7.1989	9
3M	92	-699	7.1747	2
6M	184	-1445	7.1001	9
9M	275	-2188	7.0258	7
1Y	365	-2901	6.9546	-2
18M	548	-4080	6.8366	-15
2Y	730	-4965	6.7481	15
3Y	1094	-6010	6.6436	-110
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1091	
CLOSING SPOT RATE			7.2446	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-235.8	-477.8	-1223.8	-1966.8	-2679.3
2M		-242	-988	-1731	-2443.5
3M			-746	-1489	-2201.5
6M				-743	-1455.5
9M					-712.5



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