



【2024-06-14】

今日 Fixing 定在 7.1151，较上一交易日下调了 29 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 -23~-18.5 的位置；T/N 成交在 -7.61~-7.38 的位置，S/N 成交在 -15.15~-15 的位置。1w 较多成交在 -52.7 的位置；2w 成交在 -107.3，-107.1 的位置；3s 成交在 -727，-725，-722 的位置。

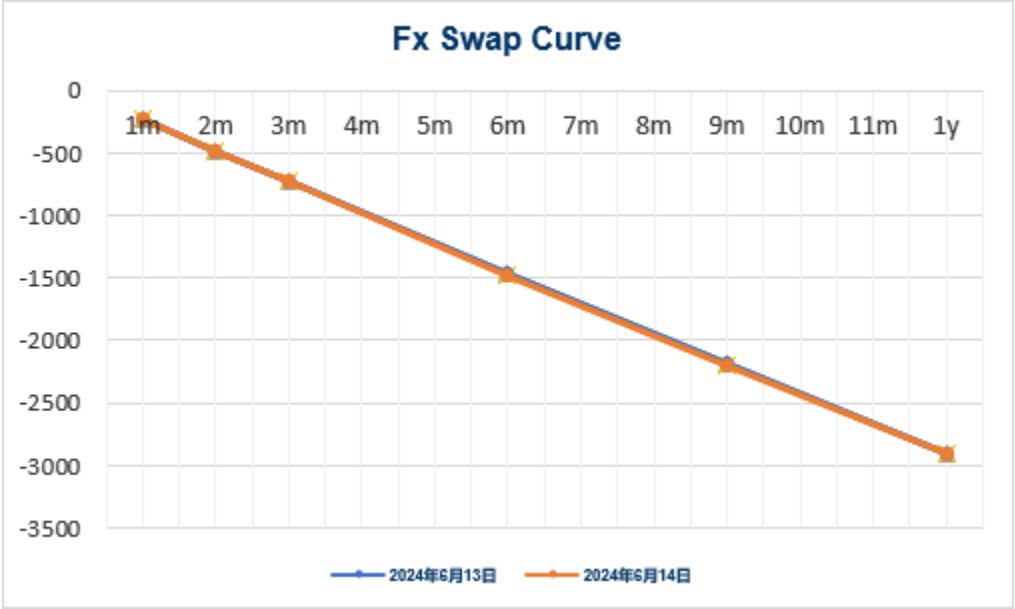
中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1468，-1457.5，-1457 的位置；9s 成交在 -2205，-2190，-2185 的位置；1y 成交在 -2898，-2892，-2885，-2884 的位置。

超长期限，2y 成交在 -4865 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -743，-742 的位置；9s*1y 成交在 -703 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2504	-0.05
2W	14	-108	7.2449	-1
1M	30	-234	7.2323	-1.3
2M	62	-485	7.2072	6
3M	92	-727	7.1831	3.5
6M	183	-1476	7.1081	-16
9M	273	-2200	7.0357	-10
1Y	365	-2908	6.9649	-9
18M	548	-4030	6.8527	-10
2Y	730	-4860	6.7697	-4
3Y	1095	-5880	6.6677	45
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1151	
CLOSING SPOT RATE			7.2557	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-251.5	-492.8	-1242.3	-1966.3	-2674.3
2M		-241.3	-990.8	-1714.8	-2422.8
3M			-749.5	-1473.5	-2181.5
6M				-724	-1432
9M					-708



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