



【2024-06-17】

今日 Fixing 定在 7.1149，较上一交易日下调了 2 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

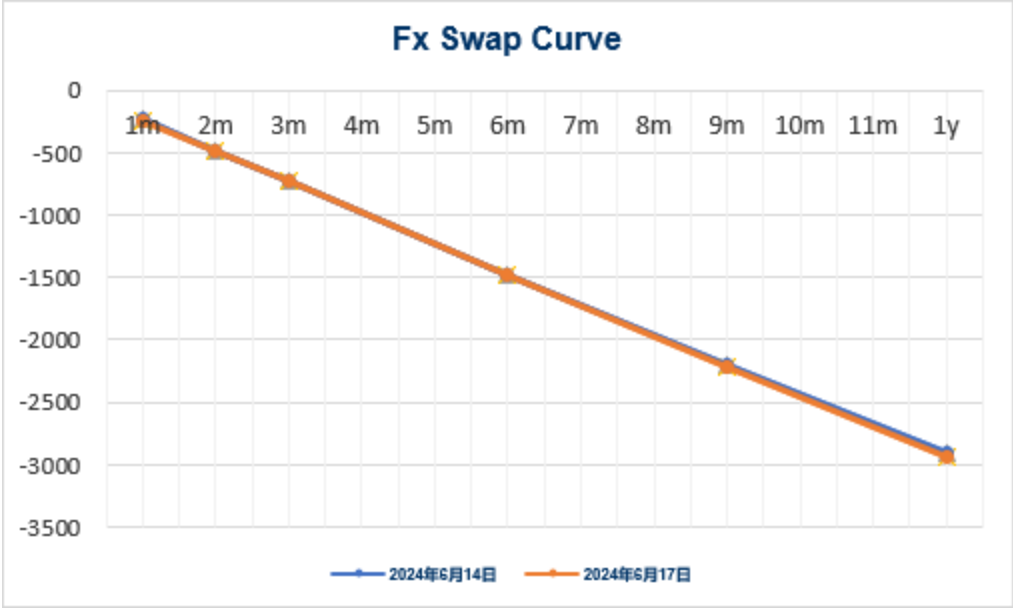
短端，O/N 成交在 -7.4~-7.2 的位置；T/N 成交在 -15.01~-14.8 的位置，S/N 成交在 -7.61~-7.5 的位置。1w 较多成交在 -53.2，-53 的位置；2w 成交在 -114.1 的位置；3w 成交在 -162 的位置；1s 成交在 -250 的位置；2s 成交在 -481 的位置。

中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1480，-1479 的位置；9s 成交在 -2220，-2218，-2215 的位置；1y 成交在 -2926，-2924，-2919，-2908 的位置。

超长期限，18s 成交在 -4090 的位置；2y 成交在 -4870 的位置；3y 成交在 -5945 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2506	-0.15
2W	15	-114	7.2445	-6
1M	32	-250	7.2309	-16.3
2M	61	-482	7.2077	3
3M	92	-730	7.1829	-3.7
6M	183	-1482	7.1078	-6
9M	273	-2215	7.0344	-15
1Y	365	-2933	6.9626	-25
18M	550	-4047	6.8512	-17
2Y	732	-4877	6.7682	-17
3Y	1096	-5955	6.6604	-75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1149	
CLOSING SPOT RATE			7.2559	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-231.8	-480.2	-1231.5	-1965	-2683
2M		-248.4	-999.7	-1733.2	-2451.2
3M			-751.3	-1484.8	-2202.8
6M				-733.5	-1451.5
9M					-718



文 / Edward Sun

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