



【2024-06-13】

今日 Fixing 定在 7.1122，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，O/N 成交在 -7.65~-6.96 的位置；T/N 成交在 -23~-22.05 的位置，S/N 成交在 -7.65~-7.56 的位置。1w 较多成交在 -53，-52.9，-52.6 的位置；2w 成交在 -107.8，-107 的位置；1s 主要成交在 -232 的位置；3s 成交在 -727.5，-727 的位置。

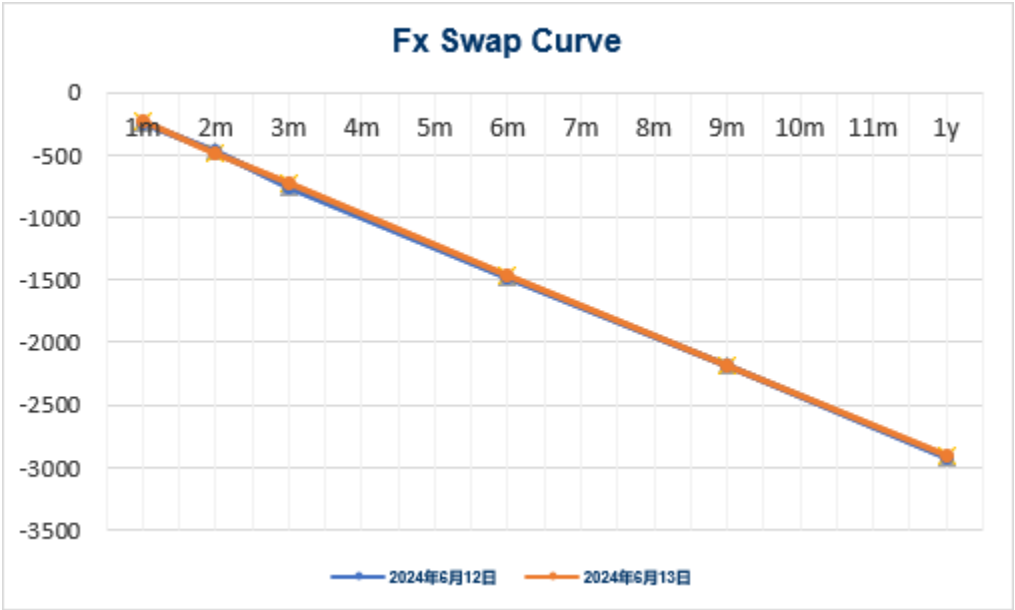
中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1460，-1458 的位置；9s 成交在 -2190，-2182 的位置；1y 成交在 -2891，-2890，-2888，-2886 的位置。

超长期限，2y 成交在 -4875，-4850 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -730 的位置；6s*9s 成交在 -726，-725 的位置；9s*1y 成交在 -709，-707 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2467	0.75
2W	14	-108	7.2413	-1
1M	30	-232	7.2288	9
2M	63	-491	7.2029	-16
3M	93	-730	7.1790	21.8
6M	183	-1460	7.1060	17
9M	273	-2190	7.0330	2
1Y	365	-2899	6.9621	22
18M	548	-4020	6.8500	40
2Y	730	-4856	6.7664	54
3Y	1095	-5925	6.6595	80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1122	
CLOSING SPOT RATE			7.2520	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-258.6	-497.6	-1227.6	-1957.6	-2666.6
2M		-239	-969	-1699	-2408
3M			-730	-1460	-2169
6M				-730	-1439
9M					-709



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