



【2024-06-19】

今日 Fixing 定在 7.1159，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 -7.45~-7.34 的位置；S/N 成交在 -22.65~-22.55 的位置。1w 较多成交在 -53.2，-53 的位置；2w 成交在 -107.5 的位置；3w 成交在 -163 的位置；1s 成交在 -241，-240.5 的位置；2s 成交在 -482 的位置；3s 成交在 -747.3 的位置。

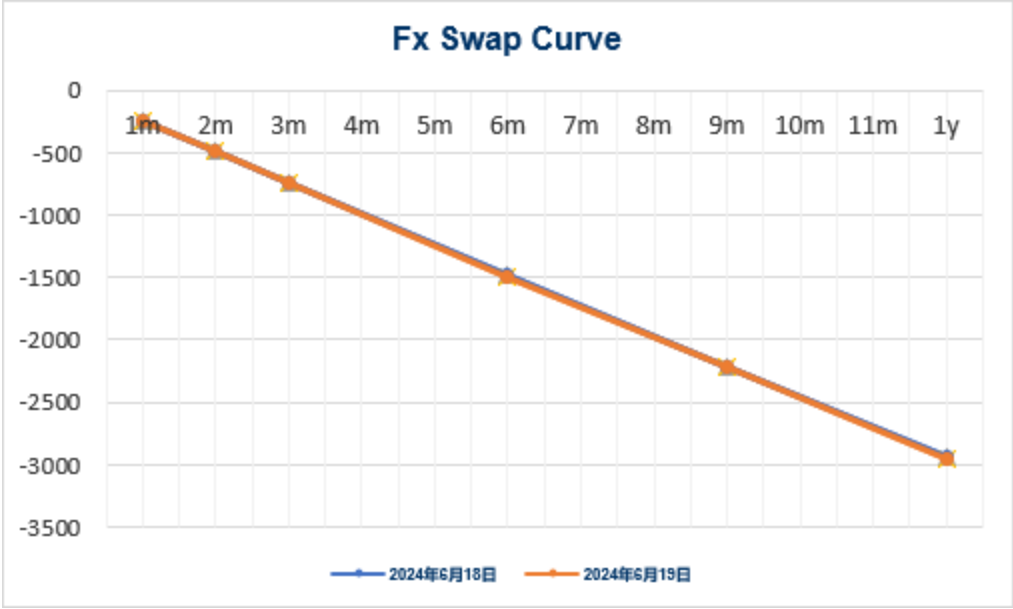
中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1495，-1490，-1485 的位置；9s 成交在 -2214，-2200 的位置；1y 成交在 -2942，-2930，-2927 的位置。

超长期限，18s 成交在 -4075，-4070 的位置。

Spread 上，6s*1y 成交在 -1449 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2517	0.57
2W	14	-109	7.2462	8
1M	31	-241	7.2329	9.65
2M	61	-482	7.2088	1
3M	94	-748	7.1822	-11.9
6M	185	-1498	7.1072	-17
9M	273	-2220	7.0350	-4
1Y	367	-2950	6.9620	-15
18M	549	-4075	6.8495	25
2Y	731	-4925	6.7645	35
3Y	1095	-5795	6.6775	205
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1159	
CLOSING SPOT RATE			7.2570	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-241.15	-507.05	-1257.15	-1979.15	-2709.15
2M		-265.9	-1016	-1738	-2468
3M			-750.1	-1472.1	-2202.1
6M				-722	-1452
9M					-730



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