【2024-06-21】

今日 Fixing 定在 7.1196，较上一交易日上调了 4 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 -21~-18.5 的位置；T/N 成交在 -7.2~-6.77 的位置；S/N 成交在 -7.25~-6.95 的位置。1w 较多成交在 -53，-52.5，-52，-51.7 的位置；2w 成交在 -107.5 的位置；1s 成交在 -231.8，-231.7，-231 的位置；2s 成交在 -484 的位置；3s 成交在 -728，-725，-724 的位置。

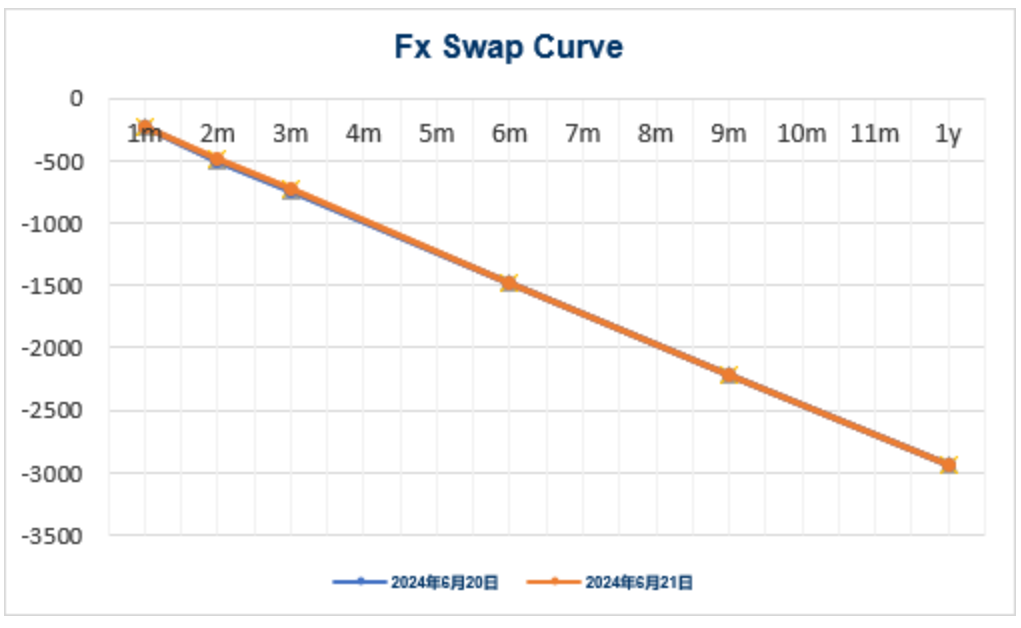
中长期限，6s 成交较少，主要成交在 -1485 的位置；9s 成交在 -2200 的位置；1y 成交在 -2942，-2941，-2940，-2920 的位置。

超长期限，18s 成交在 -4080 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -54.5 的位置；3w*1s 成交在 -70 的位置；2s*3s 成交在 -243 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2561	1.22
2W	14	-108	7.2506	1
1M	30	-231	7.2382	1.2
2M	62	-486	7.2127	11
3M	92	-728	7.1885	6
6M	184	-1483	7.1130	0
9M	273	-2216	7.0397	5
1Y	365	-2933	6.9680	12
18M	549	-4090	6.8523	25
2Y	730	-4955	6.7658	40
3Y	1095	-6025	6.6588	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1196	
CLOSING SPOT RATE			7.2613	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-255.11	-496.7	-1251.7	-1984.7	-2701.7
2M		-241.59	-996.59	-1729.59	-2446.59
3M			-755	-1488	-2205
6M				-733	-1450
9M					-717



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