



【2024-03-20】

今日 Fixing 定在 7.0968，较上一交易日上调了 17 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

短端，O/N 成交在 -7.25~-7.11 的位置，T/N 成交在 -7.18~-7.08 的位置，S/N 成交在 -21.43~-21.33 的位置。1w 成交在 -50.1， -50.07 的位置；2w 成交在 -122 的位置；3w 成交在 -150.5 的位置；1s 成交在 -222.5 的位置；2s 成交在 -440.5， -440 的位置；3s 成交在 -681.5， -681.2， -681 的位置。

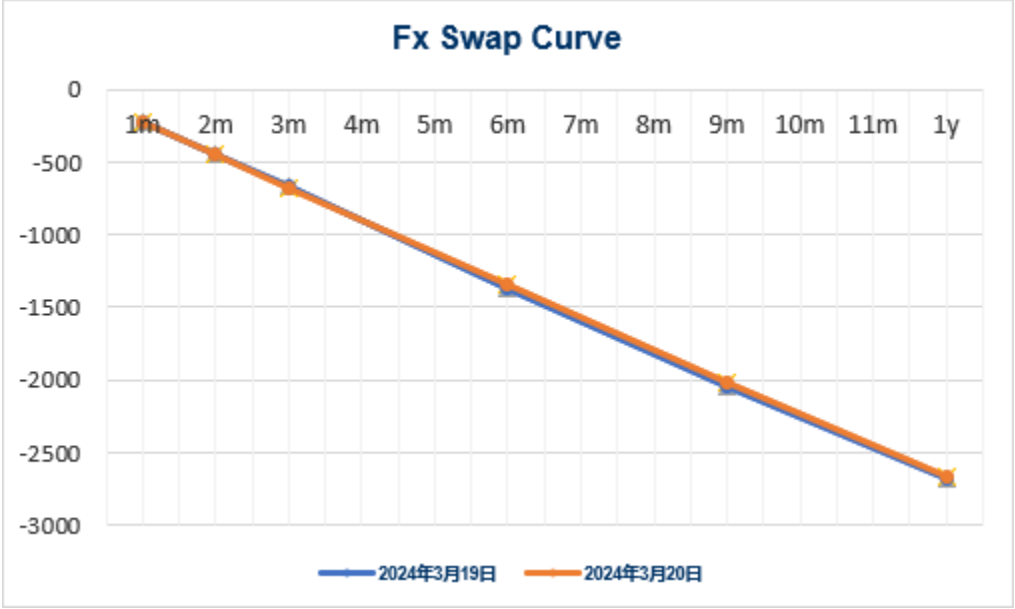
中长期，6s 成交在 -1349， -1348 的位置；9s 成交在 -2020， -2019 的位置；1y 反复成交在 -2682， -2681， -2680， -2679 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3685~-3660 的位置；2y 成交在 -4400 的位置。

Spread 上，3w*1s 成交在 -72 的位置；2s*3s 成交在 -241 的位置；3s*6s 成交在 -667 的位置；3s*9s 成交在 -1336 的位置；1y*18s 成交在 -994 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.1943	0.02
2W	17	-122	7.1871	7
1M	31	-222	7.1771	8.1
2M	61	-440	7.1553	0
3M	94	-681	7.1312	-14.8
6M	185	-1349	7.0645	15
9M	276	-2020	6.9973	21
1Y	367	-2667	6.9326	8
18M	549	-3670	6.8323	45
2Y	731	-4390	6.7603	40
3Y	1095	-5620	6.6373	80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0968	
CLOSING SPOT RATE			7.1993	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-217.33	-458.6	-1126.1	-1797.6	-2444.6
2M		-241.27	-908.77	-1580.27	-2227.27
3M			-667.5	-1339	-1986
6M				-671.5	-1318.5
9M					-647



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