



【2024-03-12】

今日 Fixing 定在 7.0963，较上一交易日下调了 6 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 -7.17~-7.14 的位置，T/N 成交在 -7.16~-7.04 的位置，S/N 成交在 -7.15~-7.05 的位置。1w 成交在 -49.2，-49.15，-49.05 的位置；2w 成交在 -98.8，-98.3 的位置；1s 成交在 -225，-224.7，-224 的位置；2s 成交在 -429 的位置；3s 成交在 -647，-646 的位置。

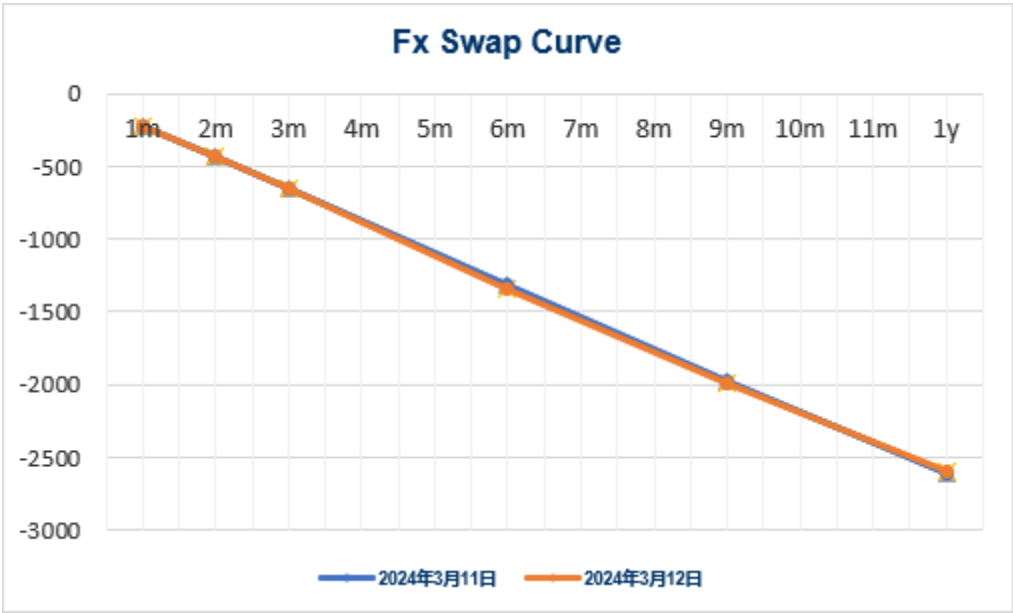
中长期，6s 成交在 -1351，-1350，-1349，-1348，-1346 的位置；9s 成交在 -1997，-1996，-1995 的位置；1y 反复成交在 -2617，-2615，-2614，-2610 的位置；15s 成交在 -3145，-3140 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3570 的位置；3y 成交在 -5560 的位置。

Spread 上，1w*1s 成交在 -174.85 的位置；1w*2w 成交在 -49.4，-49.1 的位置；3s*6s 成交在 -700 的位置；6s*9s 成交在 -647，-645 的位置；9s*1y 成交在 -608 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1694	-0.4
2W	14	-98	7.1645	0
1M	32	-224	7.1519	6
2M	61	-428	7.1315	-2
3M	92	-647	7.1096	-1
6M	188	-1341	7.0402	-21
9M	277	-1985	6.9758	-3.25
1Y	365	-2590	6.9153	15
18M	550	-3560	6.8183	30
2Y	732	-4251	6.7492	49
3Y	1096	-5500	6.6243	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0963	
CLOSING SPOT RATE			7.1743	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-204	-423	-1117	-1761	-2366
2M		-219	-913	-1557	-2162
3M			-694	-1338	-1943
6M				-644	-1249
9M					-605



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