【2024-03-18】

今日 Fixing 定在 7.0943，较上一交易日上调了 32 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

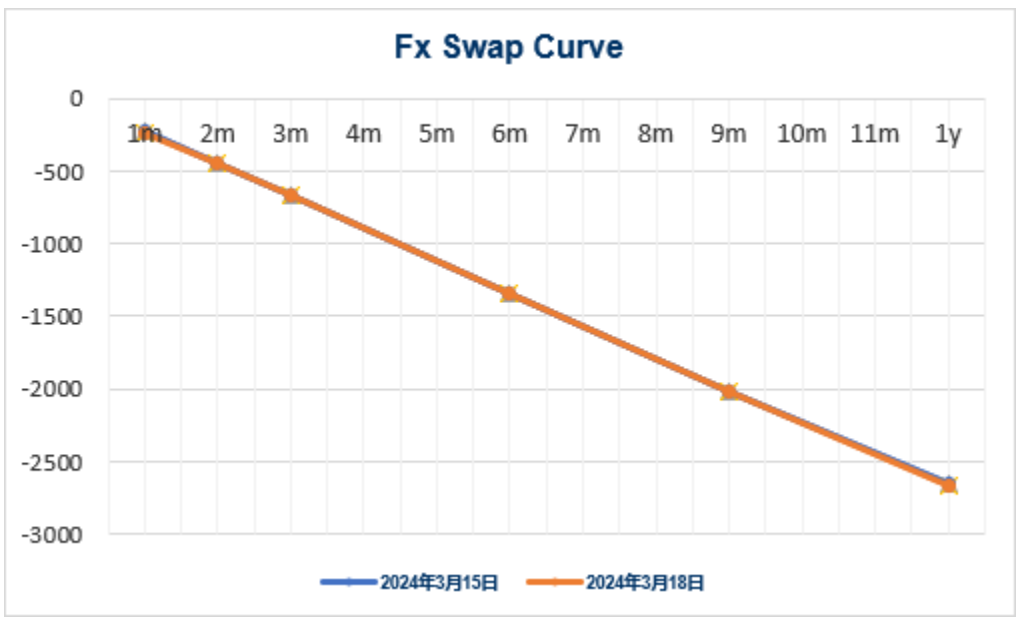
短端，O/N 成交在 -7.17~-7.15 的位置，T/N 成交在 -7.27~-7.16 的位置，S/N 成交在 -7.19~-7.17 的位置。1w 成交在 -50.2，-50.18，-50.15 的位置；1s 成交在 -237.2 的位置；3s 成交在 -664，-663，-662 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1345，-1344，-1343，-1336 的位置；9s 成交在 -2025，-2022，-2020，-2019 的位置；1y 反复成交在 -2670，-2667，-2665，-2664，-2663 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -680 的位置；9s*1y 成交在 -645，-643 的位置；1y*2y 成交在 -1725 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.1932	-0.37
2W	14	-100	7.1882	-1
1M	33	-237	7.1745	-16.2
2M	61	-439	7.1543	4
3M	92	-664	7.1318	2.5
6M	184	-1345	7.0637	-5
9M	275	-2019	6.9963	1
1Y	365	-2664	6.9318	-8
18M	551	-3690	6.8292	-40
2Y	730	-4385	6.7597	20
3Y	1097	-5700	6.6282	-40
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0943	
CLOSING SPOT RATE			7.1982	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-201.4	-426.8	-1107.8	-1781.8	-2426.8
2M		-225.4	-906.4	-1580.4	-2225.4
3M			-681	-1355	-2000
6M				-674	-1319
9M					-645



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。