【2024-03-28】

今日 Fixing 定在 7.0948，较上一交易日上调了 2 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

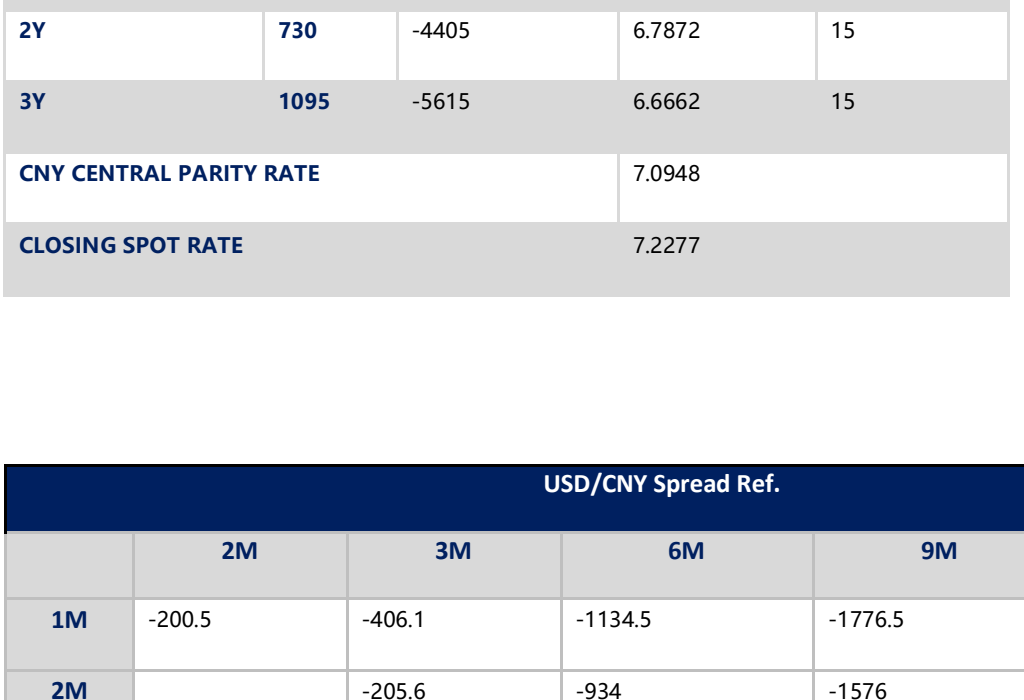
短端，O/N 成交在 -7.1~-6.95 的位置，T/N 成交在 -21.3~-20.2 的位置，S/N 成交在 -7.09~-6.9 的位置。1w 成交在 -48.8，-48.5 的位置；2w 成交在 -97.8 的位置；1s 成交在 -243.5，-243，-242.3，-242 的位置；2s 成交在 -445，-444 的位置；3s 成交在 -648.5，-648 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1376，-1375，-1374 的位置；9s 成交在 -2022 的位置；1y 反复成交在 -2670，-2668，-2666，-2660，-2657 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -49 的位置；9s*1y 成交在 -640 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.2228	22.15
2W	14	-98	7.2179	2
1M	35	-244	7.2034	-17
2M	63	-444	7.1833	6
3M	91	-650	7.1627	3.4
6M	190	-1378	7.0899	-28
9M	276	-2020	7.0257	15
1Y	365	-2660	6.9617	13
18M	556	-3725	6.8552	-15
2Y	730	-4405	6.7872	15
3Y	1095	-5615	6.6662	15
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0948	
CLOSING SPOT RATE			7.2277	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-200.5	-406.1	-1134.5	-1776.5	-2416.5
2M		-205.6	-934	-1576	-2216
3M			-728.4	-1370.4	-2010.4
6M				-642	-1282
9M					-640



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。