



【2024-03-15】

今日 Fixing 定在 7.0975，较上一交易日上调了 1 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 -21.45~-21 的位置，T/N 成交在 -7.17~-7.1 的位置，S/N 成交在 -7.15~-7.14 的位置。1w 成交在 -49.8, -49.7, -49.6, -49.3 的位置；2w 成交在 -99.7 的位置；1s 成交在 -221.5, -221 的位置；3s 成交在 -665, -664.5 的位置。

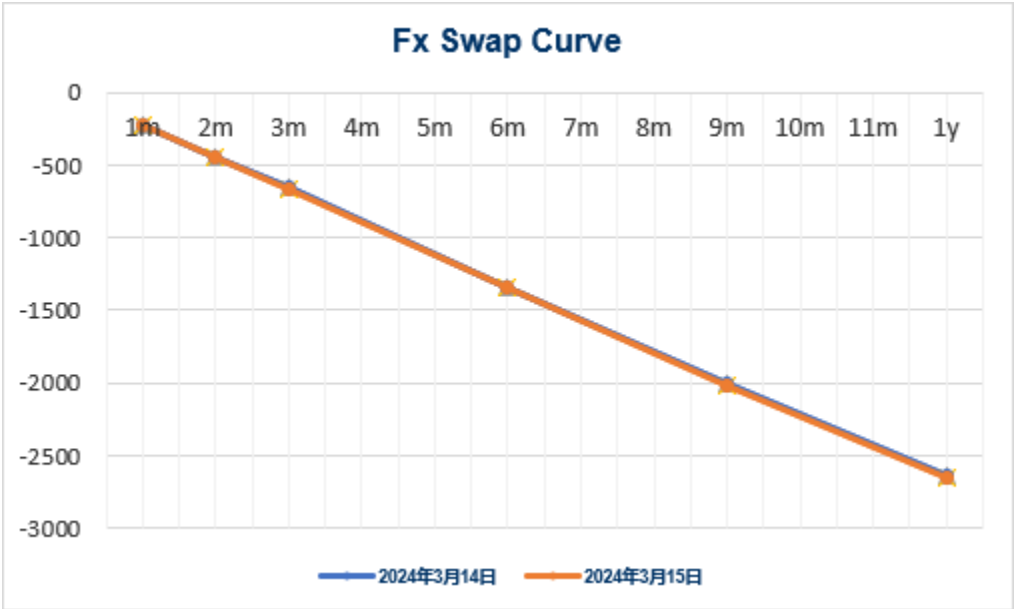
中长期，6s 成交在 -1336, -1335, -1334 的位置；9s 成交在 -2027, -2017, -2015 的位置；1y 反复成交在 -2666, -2656, -2655, -2654, -2653, -2652, -2650 的位置。

超长期限，3y 成交在 -5650 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -49.9 的位置；9s*1y 成交在 -635 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.1915	0.1
2W	14	-100	7.1865	0
1M	31	-221	7.1744	-1.2
2M	63	-443	7.1522	4
3M	92	-667	7.1299	-10.5
6M	184	-1340	7.0625	-5
9M	275	-2020	6.9945	-14
1Y	365	-2657	6.9309	-23
18M	549	-3650	6.8315	0
2Y	730	-4405	6.7560	-75
3Y	1095	-5660	6.6305	-110
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0975	
CLOSING SPOT RATE			7.1965	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-222	-445.5	-1118.8	-1799	-2435.5
2M		-223.5	-896.8	-1577	-2213.5
3M			-673.3	-1353.5	-1990
6M				-680.2	-1316.7
9M					-636.5



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