



【2024-03-13】

今日 Fixing 定在 7.0930，较上一交易日上调了 33 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 -7.2~-7.07 的位置，T/N 成交在 -7.18~-7.15 的位置，S/N 成交在 -21.6~-21.35 的位置。1w 成交在 -50.3，-50.2 的位置；2w 成交在 -100.2 的位置；3w 成交在 -170 的位置；1s 成交在 -221，-220 的位置；3s 成交在 -669，-668 的位置。

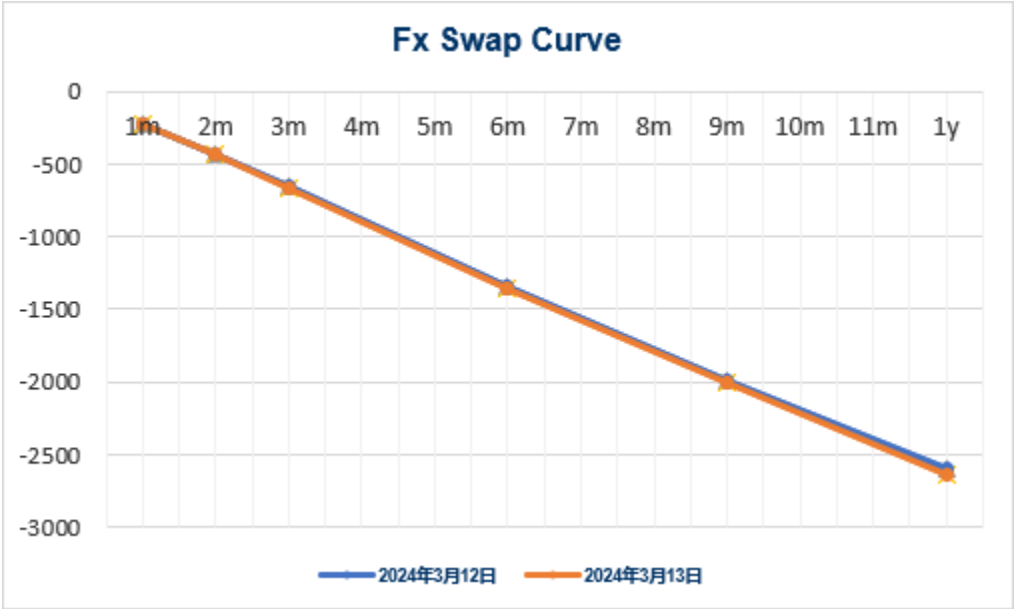
中长期，6s 成交在 -1348，-1347 的位置；9s 成交在 -2010，-2009 的位置；1y 反复成交在 -2624，-2621，-2620，-2615 的位置。

超长期，18s 成交在 -3590，-3570 的位置；2y 成交在 -4300 的位置；3y 成交在 -5500 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -49.9 的位置；6s*1y 成交在 -1277 的位置；1y*2y 成交在 -1680 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.1895	-0.9
2W	14	-100	7.1845	-2
1M	31	-220	7.1725	3.8
2M	61	-433	7.1512	-5
3M	94	-668	7.1277	-21
6M	187	-1351	7.0594	-10
9M	276	-2005	6.9940	-20
1Y	367	-2635	6.9310	-45
18M	549	-3590	6.8355	-30
2Y	731	-4300	6.7645	-49
3Y	1095	-5500	6.6445	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0930	
CLOSING SPOT RATE			7.1945	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-212.91	-447.8	-1130.8	-1784.8	-2414.8
2M		-234.89	-917.89	-1571.89	-2201.89
3M			-683	-1337	-1967
6M				-654	-1284
9M					-630



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