



【2024-03-21】

今日 Fixing 定在 7.0942，较上一交易日上调了 26 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 -7.2~-7.05 的位置，T/N 成交在 -21.3~-21.25 的位置，S/N 成交在 -7.11~-7.08 的位置。1w 成交在 -49.95，-49.9 的位置；1s 成交在 -222.5，-222.3，-222 的位置；3s 成交在 -664.5，-662.5，-662 的位置；5s 成交在 -1118，-1116，-1115 的位置。

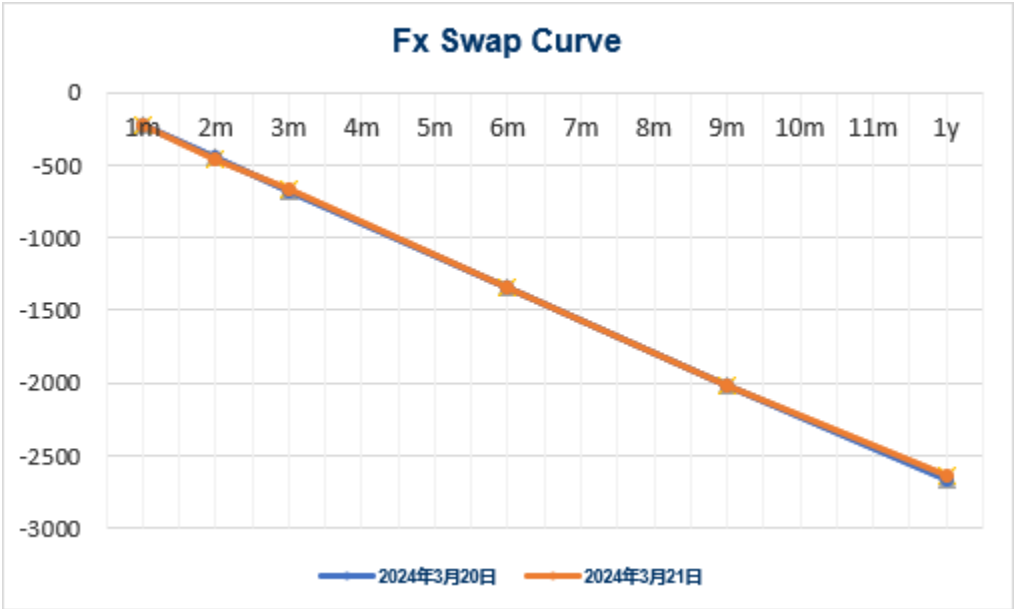
中长期，6s 成交在 -1341，-1339，-1338 的位置；9s 成交在 -2014，-2009，-2000 的位置；1y 反复成交在 -2642，-2640，-2639，-2638，-2620，-2612 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3645 的位置；2y 成交在 -4375 的位置。

Spread 上，3w*1s 成交在 -72.2 的位置；1s*3s 成交在 -442 的位置；5s*6s 成交在 -223 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.1944	0.11
2W	14	-100	7.1894	22
1M	31	-223	7.1771	-0.2
2M	64	-462	7.1533	-22
3M	92	-665	7.1329	16.1
6M	184	-1342	7.0652	7
9M	276	-2016	6.9978	4
1Y	365	-2642	6.9352	25
18M	549	-3650	6.8344	20
2Y	730	-4370	6.7624	20
3Y	1095	-5600	6.6394	20
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0942	
CLOSING SPOT RATE			7.1994	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-238.9	-442.3	-1119.4	-1793.4	-2419.4
2M		-203.4	-880.5	-1554.5	-2180.5
3M			-677.1	-1351.1	-1977.1
6M				-674	-1300
9M					-626



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