



【2024-03-06】

今日 Fixing 定在 7.1016，较上一交易日上调了 11 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 -7.18~-7.15 的位置，T/N 成交在 -7.15~-7.12 的位置，S/N 成交在 -21.25~-21.16 的位置。1w 成交在 -49.35，-49.3 的位置；2w 成交在 -98.4 的位置；3w 成交在 -146.4 的位置；1s 成交在 -219，-218 的位置；2s 成交在 -429，-428.5 的位置；3s 成交在 -672，-671，-670.5 的位置。

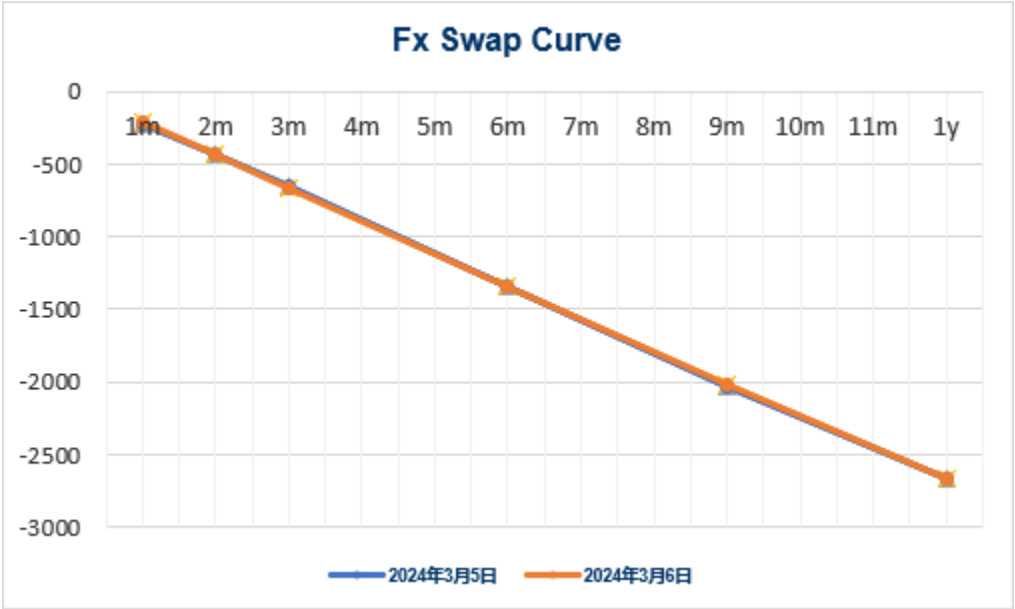
中长期，6s 成交在 -1341，-1340，-1339 的位置；9s 成交在 -2015，-2014，-2013.5 的位置；1y 反复成交在 -2689，-2688，-2687，-2686 的位置。

超长期，18s 成交在 -3695，-3685 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -49.1 的位置；6s*1y 成交在 -1335 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1943	-0.04
2W	14	-98	7.1894	0
1M	31	-217	7.1775	6.1
2M	61	-429	7.1563	-4
3M	95	-671	7.1321	-19
6M	185	-1336	7.0656	11
9M	276	-2014	6.9978	17
1Y	367	-2670	6.9322	-1
18M	549	-3680	6.8312	20
2Y	731	-4440	6.7552	20
3Y	1096	-5785	6.6207	15
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1016	
CLOSING SPOT RATE			7.1992	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-211.9	-453.9	-1119.3	-1796.9	-2452.9
2M		-242	-907.4	-1585	-2241
3M			-665.4	-1343	-1999
6M				-677.6	-1333.6
9M					-656



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