



【2024-02-26】

今日 Fixing 定在 7.1080，较上一交易日上调了 16 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 -6.99~-6.83 的位置，T/N 成交在 -6.98~-6.77 的位置，S/N 成交在 -6.96~-6.78 的位置。1w 成交在 -48.5，-48.3，-48 的位置；1s 成交在 -204.5，-204，-202 的位置；2s 成交在 -438.5，-435，-433 的位置；3s 成交在 -645，-640，-638 的位置。

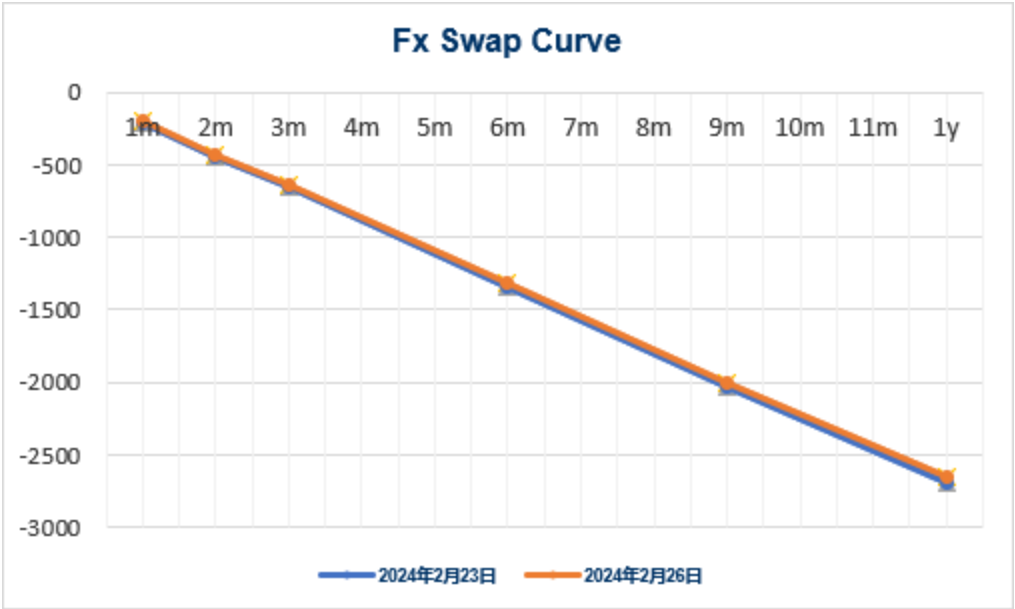
中长期，6s 成交在 -1318，-1316，-1315 的位置；9s 成交在 -2016，-2012，-2011，-2006 的位置；1y 反复成交在 -2680，-2675，-2670，-2669，-2663，-2660 的位置。

超长期，18s 成交在 -3650 的位置；2y 成交在 -4420，-4410 的位置。

Spread 上，6s*9s 成交在 -690 的位置；9s*1y 成交在 -655.5，-655 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.1933	1.4
2W	14	-98	7.1883	1
1M	29	-203	7.1778	3
2M	61	-433	7.1549	15
3M	90	-641	7.1340	15
6M	182	-1316	7.0665	22
9M	275	-2006	6.9975	23
1Y	366	-2657	6.9324	37
18M	547	-3650	6.8331	50
2Y	731	-4400	6.7581	100
3Y	1094	-5800	6.6181	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1080	
CLOSING SPOT RATE			7.1981	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-229.5	-438	-1113	-1803	-2454
2M		-208.5	-883.5	-1573.5	-2224.5
3M			-675	-1365	-2016
6M				-690	-1341
9M					-651



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