



【2024-02-21】

今日 Fixing 定在 7.1030，较上一交易日下调了 38 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

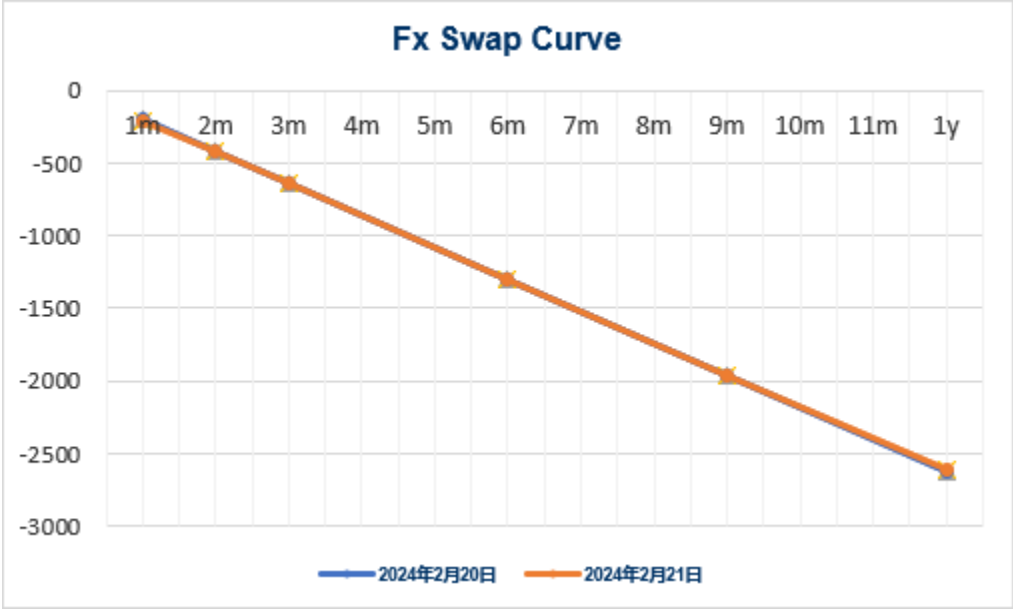
短端，O/N 成交在 -6.7~-6.5 的位置，T/N 成交在 -6.6~-6.47 的位置，S/N 成交在 -19.61~-19.5 的位置。1w 成交在 -46.7，-46.8，-46.6 的位置；2w 成交在 -94.7 的位置；1s 成交在 -212，-212.5，-212.8 的位置；2s 成交在 -418 的位置；3s 成交在 -630.5，-631.5，-631 的位置。

中长期，6s 成交在 -1290，-1287，-1292 的位置；9s 成交在 -1968，-1965，-1969 的位置；1y 反复成交在 -2605，-2600，-2602，-2603 的位置。

Spread 上，6s*9s 成交在 -676 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-47	7.1840	-0.26
2W	14	-95	7.1792	-1
1M	31	-213	7.1675	-14.8
2M	60	-418	7.1469	-1
3M	90	-632	7.1255	-0.5
6M	182	-1295	7.0593	8
9M	276	-1969	6.9918	-4
1Y	367	-2604	6.9283	19
18M	549	-3515	6.8372	50
2Y	731	-4315	6.7572	-10
3Y	1096	-5515	6.6372	-15
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1030	
CLOSING SPOT RATE			7.1887	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-205.9	-419.9	-1082	-1756.5	-2391.5
2M		-214	-876.1	-1550.6	-2185.6
3M			-662.1	-1336.6	-1971.6
6M				-674.5	-1309.5
9M					-635



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