



【2024-03-11】

今日 Fixing 定在 7.0969，较上一交易日上调了 9 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 -7.17~-7.12 的位置，T/N 成交在 -7.13~-6.92 的位置，S/N 成交在 -7.06~-6.92 的位置。1w 成交在 -49 的位置；3w 成交在 -146.5 的位置；1s 成交在 -230.1，-230 的位置；2s 成交在 -427.1 的位置；3s 成交在 -648，-647.3，-646.5，-646 的位置。

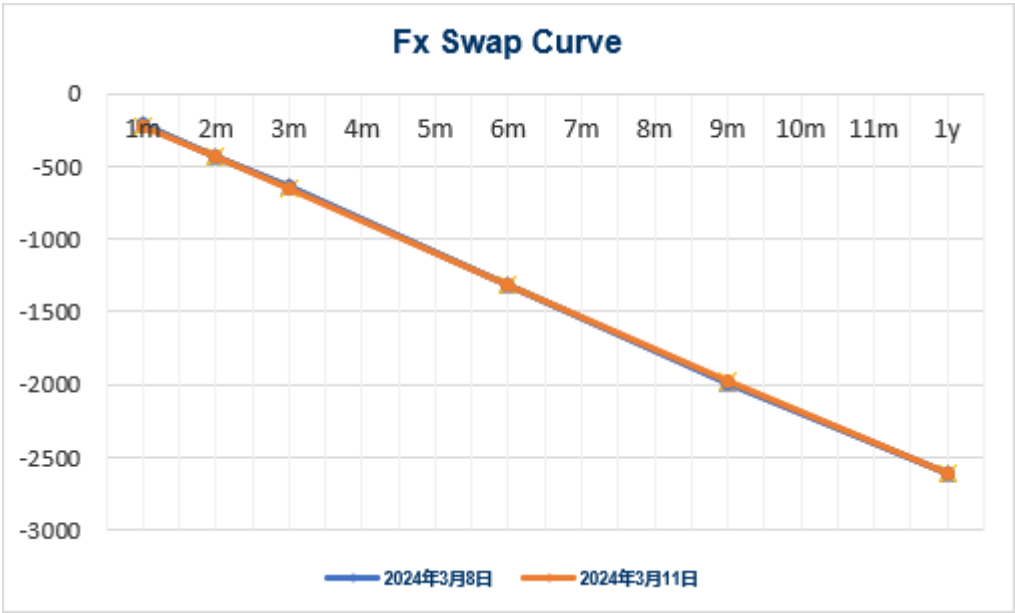
中长期，6s 成交在 -1323，-1321，-1318 的位置；9s 成交在 -1989 的位置；1y 反复成交在 -2620，-2617，-2616，-2614，-2613，-2612，-2601 的位置；15s 成交在 -3135 的位置。

超长期，18s 成交在 -3600 的位置；2y 成交在 -4300，-4290 的位置。

Spread 上，1s*2s 成交在 -197 的位置；2s*3s 成交在 -220 的位置；6s*1y 成交在 -1296 的位置；6s*1y*18s 成交在 -300 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1791	-0.5
2W	14	-98	7.1742	-1
1M	33	-230	7.1610	-15.55
2M	61	-426	7.1414	4
3M	92	-646	7.1194	-4
6M	184	-1320	7.0520	-7
9M	275	-1982	6.9858	1.25
1Y	365	-2605	6.9235	9
18M	551	-3590	6.8250	10
2Y	730	-4300	6.7540	0
3Y	1097	-5550	6.6290	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0969	
CLOSING SPOT RATE			7.1840	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-196.4	-416	-1090	-1751.75	-2375
2M		-219.6	-893.6	-1555.35	-2178.6
3M			-674	-1335.75	-1959
6M				-661.75	-1285
9M					-623.25



文 / Edward Sun

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