



【2024-03-27】

今日 Fixing 定在 7.0946，较上一交易日下调了 3 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 -6.9~-6.34 的位置，T/N 成交在 -7.21~-6.86 的位置，S/N 成交在 -21.8~-21.35 的位置。1w 成交在 -74，-72.5，-72.2，-71.6 的位置；2w 成交在 -100.4，-100 的位置；1s 成交在 -232，-231.6，-228.5，-226.7，-226.5 的位置；2s 成交在 -452 的位置；3s 成交在 -658，-657 的位置。

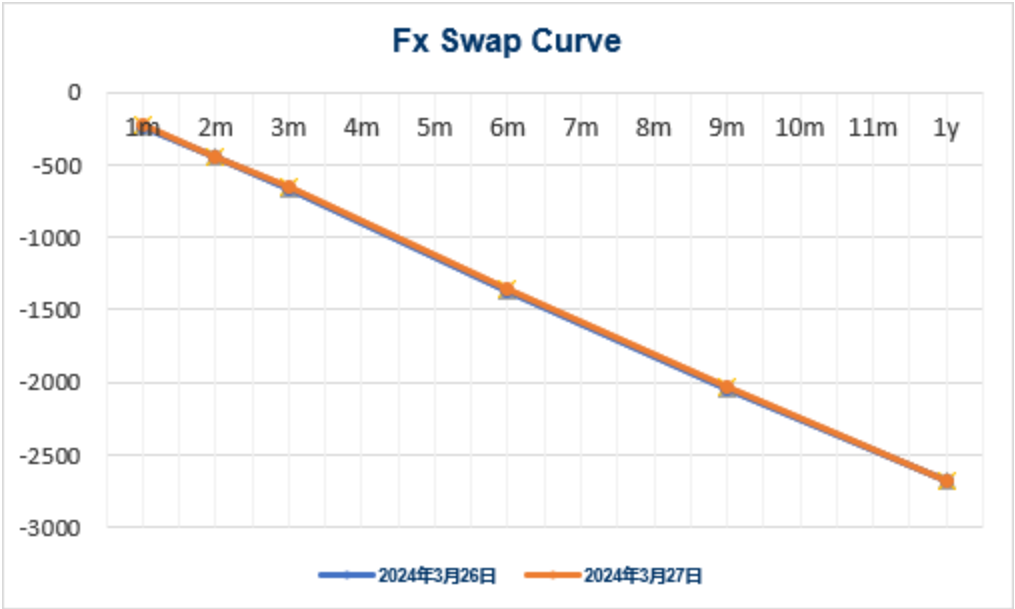
中长期，6s 成交在 -1355，-1353，-1352 的位置；9s 成交在 -2035 的位置；1y 反复成交在 -2688，-2687，-2686，-2685，-2684，-2682 的位置。

超长期，2y 成交在 -4430，-4420 的位置；3y 成交在 -5630 的位置。

Spread 上，1w*1s 成交在 -155.5 的位置；2s*3s 成交在 -203 的位置；6s*1y 成交在 -1333，-1330 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	10	-71	7.2213	10.68
2W	14	-99	7.2185	4
1M	32	-227	7.2058	6.9
2M	63	-450	7.1834	-6
3M	91	-653	7.1631	13.6
6M	185	-1350	7.0934	15
9M	277	-2035	7.0249	12
1Y	367	-2673	6.9611	5
18M	550	-3710	6.8574	-50
2Y	732	-4420	6.7864	-15
3Y	1097	-5630	6.6654	25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0946	
CLOSING SPOT RATE			7.2284	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-223.68	-426.5	-1123.5	-1808.5	-2446.5
2M		-202.82	-899.82	-1584.82	-2222.82
3M			-697	-1382	-2020
6M				-685	-1323
9M					-638



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