



【2024-02-29】

今日 Fixing 定在 7.1036，较上一交易日下调了 39 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

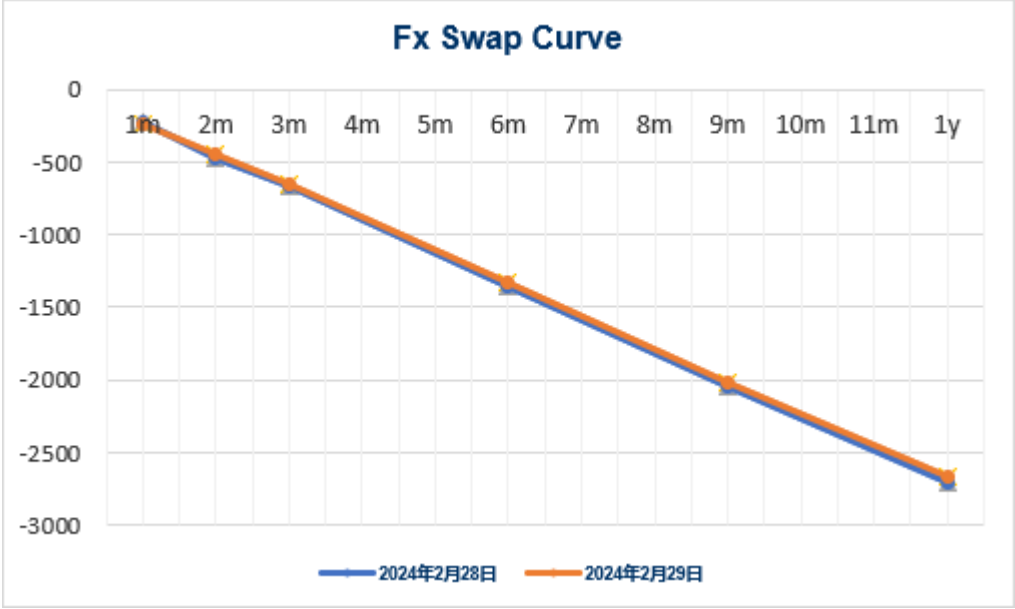
短端，O/N 成交在 -7.4~-7 的位置，T/N 成交在 -21.12~-20.8 的位置，S/N 成交在 -7.05~-7.04 的位置。1w 成交在 -49，-48.8，-48.8 的位置；2w 成交在 -98，-97.5，-97 的位置；3w 成交在 -145.6 的位置；1s 成交在 -246，-245.5，-244.5，-244，-243.5 的位置；2s 成交在 -444 的位置；3s 成交在 -653，-651.5，-651，-650，-648 的位置。

中长期，6s 成交在 -1333，-1332.5，-1330 的位置；9s 成交在 -2025，-2023，-2020，-2017 的位置；1y 反复成交在 -2675，-2674，-2670，-2667，-2665 的位置。

Spread 上，1s*3s 成交在 -405.5 的位置；3s*6s 成交在 -680 的位置；3w*1s 成交在 -98.4 的位置；1w*2w 成交在 -48.6 的位置；2w*3w 成交在 -48.5 的位置；6s*9s*1y 成交在 -41 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1881	1.19
2W	14	-100	7.1830	1
1M	35	-243	7.1687	-23.2
2M	63	-443	7.1487	29
3M	92	-648	7.1282	23.4
6M	184	-1330	7.0600	26
9M	275	-2016	6.9914	26
1Y	365	-2663	6.9267	37
18M	549	-3685	6.8245	15
2Y	730	-4450	6.7480	100
3Y	1095	-5850	6.6080	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1036	
CLOSING SPOT RATE			7.1930	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-199.8	-404.8	-1086.8	-1772.8	-2419.8
2M		-205	-887	-1573	-2220
3M			-682	-1368	-2015
6M				-686	-1333
9M					-647



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