



【2024-03-22】

今日 Fixing 定在 7.1004，较上一交易日下调了 62 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

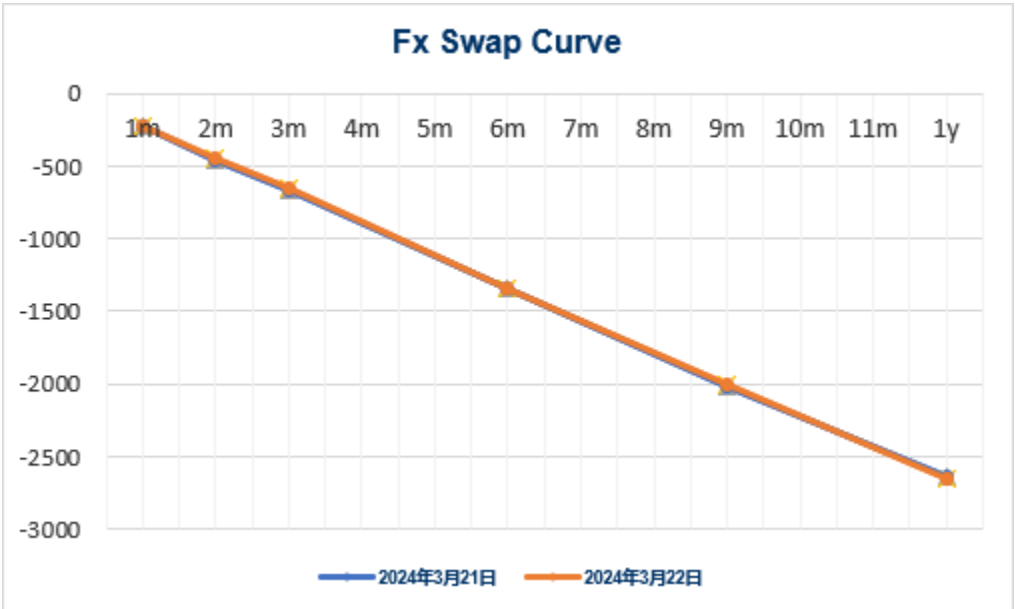
短端，O/N 成交在 -21.5~-20.5 的位置，T/N 成交在 -7.15~-6.94 的位置，S/N 成交在 -7.04~-6.98 的位置。1w 成交在 -49.3，-49.25，-49.1，-49 的位置；2w 成交在 -99，-98.5 的位置；3w 成交在 -147.5 的位置；1s 成交在 -221，-220.9，-220，-218.95 的位置；3s 成交在 -662，-660.5，-660，-659 的位置；4s 成交在 -876，-875 的位置；5s 成交在 -1103 的位置。

中长期，6s 成交在 -1339，-1335 的位置；9s 成交在 -2015 的位置；1y 反复成交在 -2660，-2658，-2649，-2647，-2643，-2642 的位置。

超长期，18s 成交在 -3660 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.2234	0.57
2W	14	-99	7.2184	1
1M	31	-219	7.2064	3.6
2M	63	-446	7.1837	16
3M	92	-658	7.1625	6.9
6M	184	-1338	7.0945	4
9M	275	-2009	7.0274	7
1Y	365	-2650	6.9633	-8
18M	549	-3640	6.8643	10
2Y	730	-4370	6.7913	0
3Y	1095	-5580	6.6703	20
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1004	
CLOSING SPOT RATE			7.2283	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-227	-439	-1119	-1790	-2431
2M		-212	-892	-1563	-2204
3M			-680	-1351	-1992
6M				-671	-1312
9M					-641



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