



【2024-03-29】

今日 Fixing 定在 7.0950，较上一交易日上调了 2 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 -19~-18.4 的位置，T/N 成交在 -7.1~-6.3 的位置，S/N 成交在 -6.85~-6.67 的位置。1w 成交在 -48.3，-48 的位置；2w 成交在 -96.5 的位置； 1s 成交在 -236 的位置；3s 成交在 -649，-648.5 的位置。

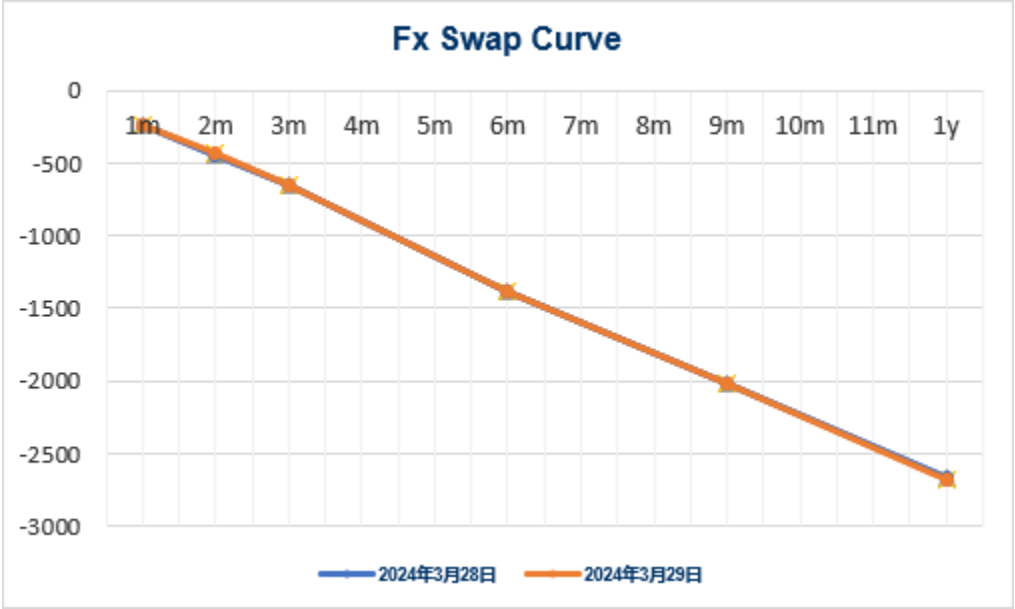
中长期，6s 成交在 -1376，-1375，-1374 的位置；9s 成交在 -2021，-2018，-2016 的位置；1y 反复成交在 -2677，-2674，-2673，-2669，-2668，-2667 的位置。

超长期限，18s 成交在 -3727，-3725 的位置；2y 成交在 -4427，-4425 的位置；3y 成交在 -5600，-5550 的位置。

Spread 上，9s*1y 成交在 -653，-652 的位置；18s*2y 成交在 -700 的位置；6s*1y*18s 成交在 -250 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.2184	0.85
2W	14	-97	7.2136	1
1M	34	-236	7.1996	7.4
2M	62	-438	7.1794	6
3M	91	-649	7.1583	0.6
6M	189	-1377	7.0855	1
9M	275	-2021	7.0211	-1
1Y	365	-2675	6.9557	-15
18M	555	-3730	6.8502	-5
2Y	730	-4427	6.7805	-22
3Y	1095	-5550	6.6682	65
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0950	
CLOSING SPOT RATE			7.2232	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-201.9	-412.9	-1140.9	-1784.9	-2438.9
2M		-211	-939	-1583	-2237
3M			-728	-1372	-2026
6M				-644	-1298
9M					-654



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