



【2024-03-14】

今日 Fixing 定在 7.0974，较上一交易日上调了 44 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 -7.17~-6.8 的位置，T/N 成交在 -21.7~-21.53 的位置，S/N 成交在 -7.2~-7.15 的位置。1w 成交在 -50.2， -50.15， -50， -49.9 的位置；2s 成交在 -451， -448 的位置；3s 成交在 -660， -659， -658， -656 的位置；5s 成交在 -1112， -1111 的位置。

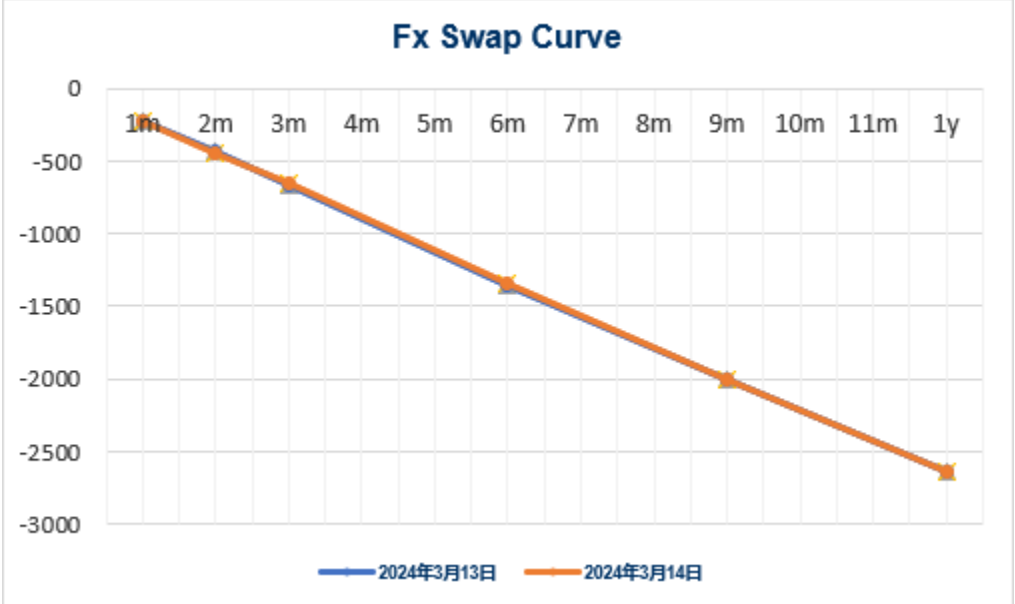
中长期，6s 成交在 -1340， -1336， -1335 的位置；9s 成交在 -2017， -2015， -2013， -2004 的位置；1y 反复成交在 -2649， -2647， -2640， -2635， -2634， -2624， -2623 的位置。

超长期限，3y 成交在 -5550 的位置。

Spread 上，2s\*3s 成交在 -207 的位置；5s\*6s 成交在 -224 的位置；3s\*9s 成交在 -1355 的位置；9s\*1y 成交在 -632， -630 的位置。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 7    | -50        | 7.1861       | 0.4        |
| 2W                      | 14   | -100       | 7.1811       | 0          |
| 1M                      | 31   | -220       | 7.1691       | 0.4        |
| 2M                      | 63   | -447       | 7.1464       | -14        |
| 3M                      | 92   | -656       | 7.1255       | 12         |
| 6M                      | 184  | -1335      | 7.0576       | 16         |
| 9M                      | 275  | -2006      | 6.9905       | -1         |
| 1Y                      | 365  | -2634      | 6.9277       | 1          |
| 18M                     | 549  | -3650      | 6.8261       | -60        |
| 2Y                      | 730  | -4330      | 6.7581       | -30        |
| 3Y                      | 1095 | -5550      | 6.6361       | -50        |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 7.0974       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 7.1911       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |        |        |         |         |         |
|---------------------|--------|--------|---------|---------|---------|
|                     | 2M     | 3M     | 6M      | 9M      | 1Y      |
| 1M                  | -227.2 | -436.2 | -1115.2 | -1786.2 | -2414.2 |
| 2M                  |        | -209   | -888    | -1559   | -2187   |
| 3M                  |        |        | -679    | -1350   | -1978   |
| 6M                  |        |        |         | -671    | -1299   |
| 9M                  |        |        |         |         | -628    |



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