

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-03-04】

今日 Fixing 定在 7.1020，较上一交易日上调了 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。

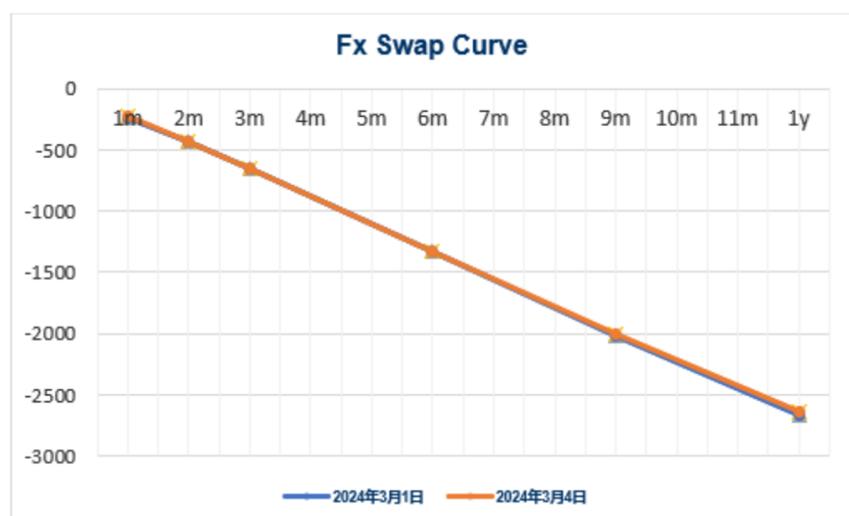
短端，O/N 成交在 -7.25~-7.18 的位置，T/N 成交在 -7.23~-6.95 的位置，S/N 成交在 -7.1~-7.09 的位置。1w 成交在 -49，-48.9 的位置；3w 成交在 -145.5 的位置；1s 成交在 -229.8，-229.5 的位置；2s 成交在 -428 的位置；3s 成交在 -650，-647.5 的位置；4s 成交在 -877 的位置。

中长期，6s 成交在 -1322，-1321，-1320 的位置；9s 成交在 -2001，-1999 的位置；1y 反复成交在 -2647，-2643，-2641，-2640 的位置。

Spread 上，1w\*1s 成交在 -180.5 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1941	-0.03
2W	14	-98	7.1892	0
1M	33	-230	7.1760	7
2M	61	-428	7.1562	8
3M	92	-649	7.1341	0.5
6M	184	-1321	7.0669	8
9M	275	-1998	6.9992	15.3
1Y	365	-2644	6.9346	18
18M	551	-3675	6.8315	10
2Y	730	-4405	6.7585	45
3Y	1097	-5725	6.6265	75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1020	
CLOSING SPOT RATE			7.1990	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-198.3	-419.3	-1091.3	-1768.3	-2414.3
2M		-221	-893	-1570	-2216
3M			-672	-1349	-1995
6M				-677	-1323
9M					-646



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**