

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-03-01】

今日 Fixing 定在 7.1059，较上一交易日上调了 23 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

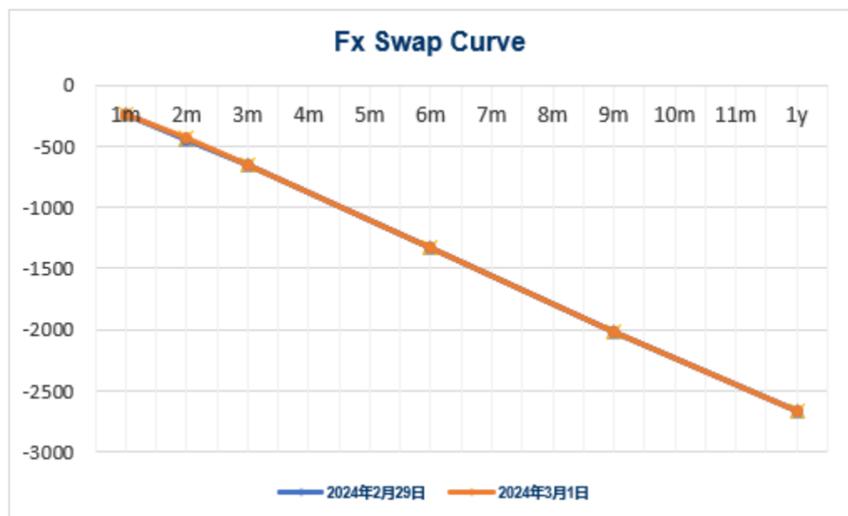
短端，O/N 成交在 -21.4~-21 的位置，T/N 成交在 -7.15~-6.95 的位置，S/N 成交在 -7.11~-7 的位置。1w 成交在 -48.9，-48.88，-48.85 的位置；2w 成交在 -97.5，-97 的位置；1s 成交在 -237，-236.5，-236.25，-236 的位置；2s 成交在 -436 的位置；3s 成交在 -650.5，-650 的位置。

中长期，6s 成交在 -1330，-1329，-1328，-1327 的位置；9s 成交在 -2013 的位置；1y 反复成交在 -2666，-2663，-2662，-2658，-2656 的位置。

Spread 上，1s*2s 成交在 -200 的位置；6s*9s 成交在 -684，-683，-682 的位置；9s*1y 成交在 -647 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1936	-0.21
2W	14	-98	7.1887	2
1M	34	-237	7.1748	6.5
2M	62	-436	7.1549	7
3M	92	-650	7.1336	-1.5
6M	184	-1329	7.0656	1
9M	275	-2013	6.9972	2.7
1Y	365	-2662	6.9323	1
18M	549	-3685	6.8300	0
2Y	730	-4450	6.7535	0
3Y	1095	-5800	6.6185	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1059	
CLOSING SPOT RATE			7.1985	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-198.95	-412.8	-1092.3	-1776.6	-2425.3
2M		-213.85	-893.35	-1577.65	-2226.35
3M			-679.5	-1363.8	-2012.5
6M				-684.3	-1333
9M					-648.7



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