

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-02-19】

今日 Fixing 定在 7.1032, 较上一交易日下调了 4 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所下行。

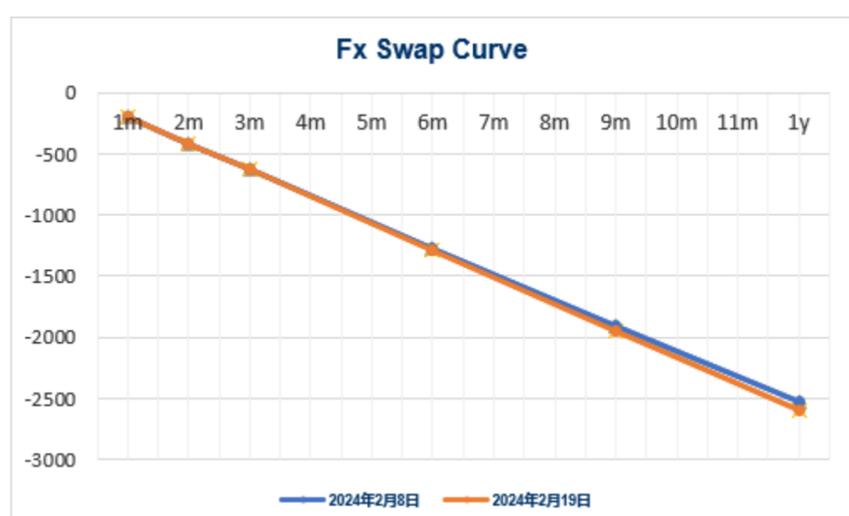
短端, T/N 成交在 -6.62~-6.55 的位置, S/N 成交在 -6.59~-6.3 的位置。1w 成交在 -46.8, -46.7, -46.6 的位置; 1s 成交在 -196, -196.3, -196.2 的位置; 2s 成交在 -420.5 的位置; 3s 成交在 -628 的位置。

中长期, 6s 成交在 -1288, -1289, -1286, -1287 的位置; 9s 成交在 -1952, -1955, -1949 的位置; 1y 反复成交在 -2597, -2598, -2592, -2591, -2595, -2596 的位置。

Spread 上, 6s*1y 成交在 -1306 的位置; 3s*9s 成交在 -1320 的位置; 9s*1y 成交在 -642, -641.5, -643 的位置; 6s*9s*1y 成交在 -20 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-47	7.1930	24.7
2W	14	-93	7.1883	-2
1M	29	-196	7.1780	9.6
2M	61	-422	7.1555	-14
3M	90	-628	7.1348	-10
6M	182	-1290	7.0686	-36
9M	274	-1952	7.0024	-47
1Y	366	-2595	6.9381	-90
18M	547	-3535	6.8441	-140
2Y	733	-4300	6.7676	-225
3Y	1097	-5500	6.6476	-250
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1032	
CLOSING SPOT RATE			7.1976	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-225.8	-432.3	-1094.2	-1756.3	-2399.3
2M		-206.5	-868.4	-1530.5	-2173.5
3M			-661.9	-1324	-1967
6M				-662.1	-1305.1
9M					-643



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