

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-03-25】

今日 Fixing 定在 7.0996，较上一交易日下调了 8 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 -7.9~-7.1 的位置，T/N 成交在 -7.3~-6.86 的位置，S/N 成交在 -7.37~-6.9 的位置。1w 成交在 -51.5, -51.3, -49.4, -49.35 的位置；2w 成交在 -101.5 的位置；3w 成交在 -150 的位置；1s 成交在 -234.5, -233.8, -233.5, -233 的位置；3s 成交在 -666.6, -664.6, -658, -657 的位置。

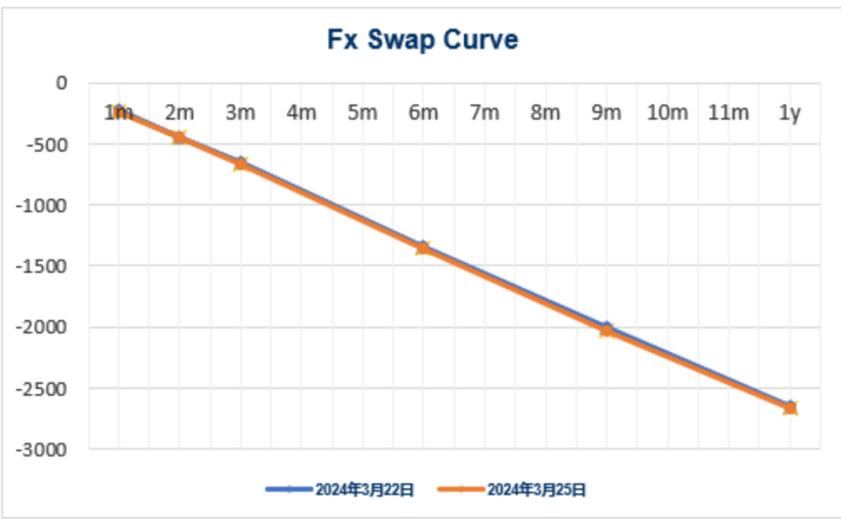
中长期，6s 成交在 -1332, -1331 的位置；9s 成交在 -2020 的位置；1y 反复成交在 -2668, -2660, -2655, -2650, -2649, -2648, -2645 的位置。

超长期，18s 成交在 -3655, -3650 的位置。

Spread 上，1y*2y 成交在 -1720 的位置。

| Tenor | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W | 7 | -51 | 7.2033 | -1.7 |
| 2W | 14 | -102 | 7.1982 | -3 |
| 1M | 33 | -239 | 7.1845 | -20.1 |
| 2M | 62 | -450 | 7.1634 | -4 |
| 3M | 92 | -668 | 7.1416 | -10 |
| 6M | 184 | -1350 | 7.0734 | -12 |
| 9M | 275 | -2025 | 7.0059 | -16 |
| 1Y | 365 | -2660 | 6.9424 | -10 |
| 18M | 551 | -3660 | 6.8424 | -20 |
| 2Y | 730 | -4400 | 6.7684 | -30 |
| 3Y | 1097 | -5630 | 6.6454 | -50 |
| CNY CENTRAL PARITY RATE | | | 7.0996 | |
| CLOSING SPOT RATE | | | 7.2084 | |

| USD/CNY Spread Ref. | | | | | |
|---------------------|--------|--------|---------|---------|---------|
| | 2M | 3M | 6M | 9M | 1Y |
| 1M | -210.9 | -428.9 | -1110.9 | -1785.9 | -2420.9 |
| 2M | | -218 | -900 | -1575 | -2210 |
| 3M | | | -682 | -1357 | -1992 |
| 6M | | | | -675 | -1310 |
| 9M | | | | | -635 |



文 / Edward Sun

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