

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-02-22】

今日 Fixing 定在 7.1018, 较上一交易日下调了 12 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所下行。

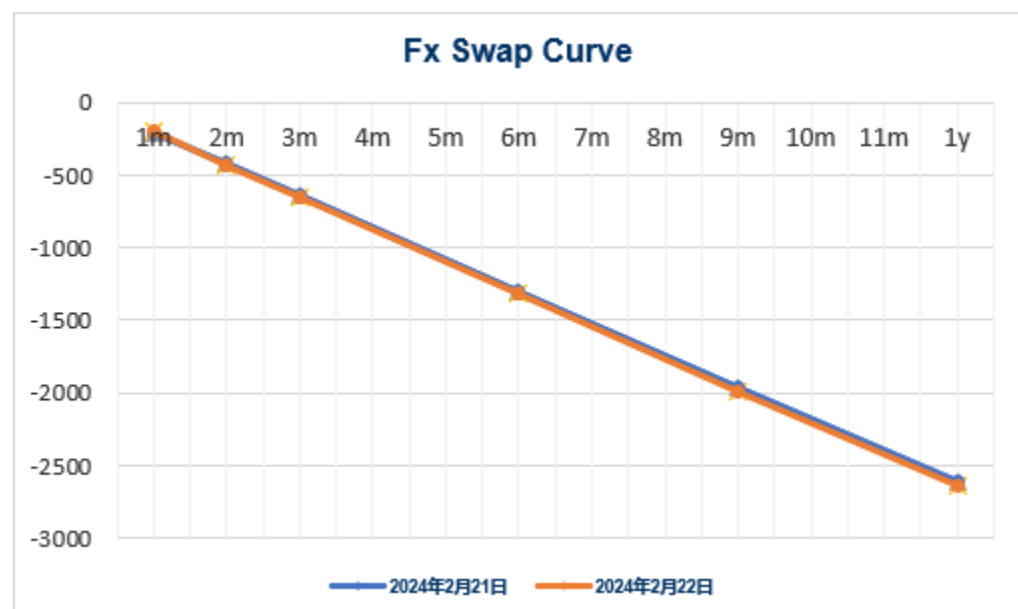
短端, O/N 成交在 -6.75~-6.7 的位置, T/N 成交在 -21~-19.8 的位置, S/N 成交在 -6.99~-6.79 的位置。1w 成交在 -47.9, -48, -48.5, -48.45 的位置; 2w 成交在 -97 的位置; 1s 成交在 -202, -202.5 的位置; 2s 成交在 -423.5, -424 的位置; 3s 成交在 -653, -654, -653.5 的位置。

中长期, 6s 成交在 -1314, -1315, -1313.5 的位置; 9s 成交在 -1986, -1987 的位置; 1y 反复成交在 -2623, -2630, -2635, -2634 的位置。

Spread 上, 3s*6s 成交在 -656, -658, -660.5 的位置; 3s*1y 成交在 -1970 的位置; 9s*1y 成交在 -646, -650 的位置; 6s*9s 成交在 -670 的位置; 6s*1y 成交在 -1314, -1320 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1810	-1.9
2W	14	-97	7.1762	-2
1M	29	-203	7.1656	9.65
2M	60	-425	7.1434	-6
3M	92	-655	7.1204	-22.5
6M	182	-1318	7.0541	-24
9M	274	-1989	6.9870	-20
1Y	366	-2640	6.9219	-36
18M	547	-3625	6.8234	-110
2Y	731	-4370	6.7489	-55
3Y	1096	-5700	6.6159	-185
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1018	
CLOSING SPOT RATE			7.1859	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-221.78	-452.05	-1115.15	-1786.15	-2437.15
2M		-230.27	-893.37	-1564.37	-2215.37
3M			-663.1	-1334.1	-1985.1
6M				-671	-1322
9M					-651



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