

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-02-28】

今日 Fixing 定在 7.1075, 较上一交易日上调了 18 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所下行。

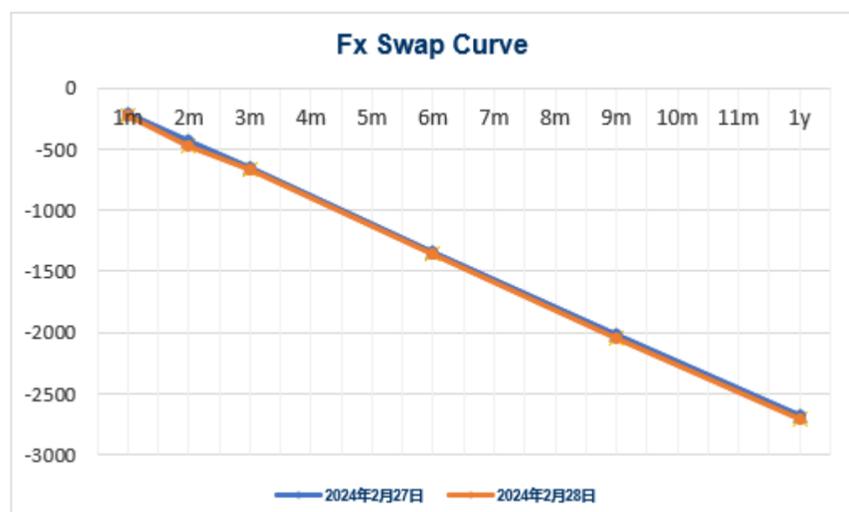
短端, O/N 成交在 -7.4~-7.35 的位置, T/N 成交在 -7.37~-7.25 的位置, S/N 成交在 -21.82~-21.8 的位置。1w 成交在 -50.2, -50 的位置; 1s 成交在 -221, -220.8, -220 的位置; 2s 成交在 -473.5, -473, -472 的位置; 3s 成交在 -675, -674.5, -674 的位置。

中长期, 6s 成交在 -1365, -1363, -1361, -1350 的位置; 9s 成交在 -2052, -2050, -2048, -2046 的位置; 1y 反复成交在 -2735, -2723, -2720, -2719, -2718, -2710, -2708 的位置。

Spread 上, 2s*3s 成交在 -201 的位置; 3s*6s 成交在 -687 的位置; 6s*1y 成交在 -1355 的位置; 1s*3s 成交在 -453 的位置; 1s*9s 成交在 -1832 的位置; 6s*9s*1y 成交在 -23 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.1936	-0.8
2W	14	-101	7.1885	-2
1M	31	-220	7.1766	-15.1
2M	66	-472	7.1514	-39
3M	94	-671	7.1315	-14.8
6M	186	-1356	7.0630	-21
9M	276	-2042	6.9944	-24
1Y	367	-2700	6.9286	-21
18M	550	-3700	6.8286	0
2Y	731	-4550	6.7436	-75
3Y	1095	-5900	6.6086	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1075	
CLOSING SPOT RATE			7.1986	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-251.7	-451.4	-1136	-1822	-2480
2M		-199.7	-884.3	-1570.3	-2228.3
3M			-684.6	-1370.6	-2028.6
6M				-686	-1344
9M					-658



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