

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-02-27】

今日 Fixing 定在 7.1057, 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下行。

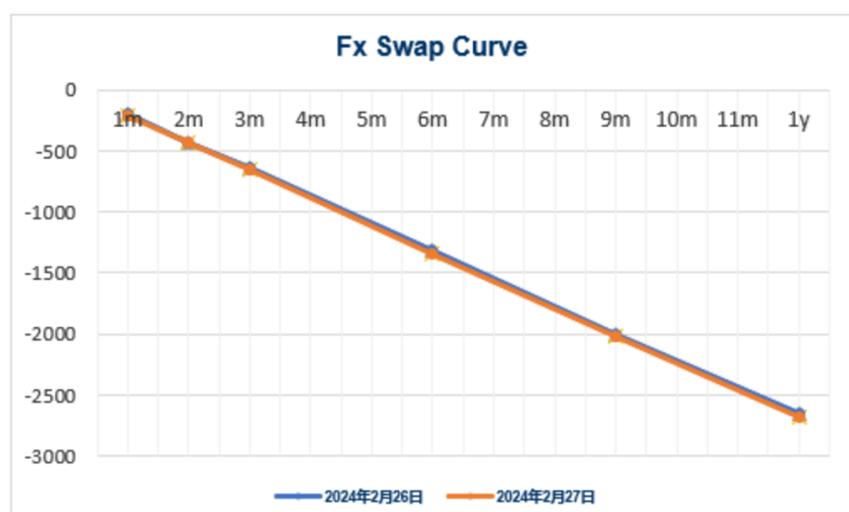
短端, O/N 成交在 -7~-6.92 的位置, T/N 成交在 -6.9~-6.8 的位置, S/N 成交在 -6.98~-6.88 的位置。1w 成交在 -49, -48.9 的位置; 1s 成交在 -204.8, -204.5, -203 的位置; 2s 成交在 -434 的位置; 3s 成交在 -658, -657 的位置; 4s 成交在 -863 的位置。

中长期, 6s 成交在 -1335, -1334 的位置; 9s 成交在 -2014, -2013 的位置; 1y 反复成交在 -2685, -2680, -2675, -2674, -2673, -2668, -2665 的位置。

Spread 上, 9s\*1y 成交在 -660, -659 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1929	-0.65
2W	14	-99	7.1880	-1
1M	29	-205	7.1773	-1.9
2M	61	-433	7.1545	-1
3M	92	-657	7.1321	-15.6
6M	183	-1335	7.0643	-19
9M	274	-2018	6.9960	-12
1Y	365	-2679	6.9299	-22
18M	547	-3700	6.8278	-50
2Y	730	-4475	6.7503	-75
3Y	1093	-5800	6.6178	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1057	
CLOSING SPOT RATE			7.1978	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-228.1	-451.7	-1130.1	-1813.1	-2474.1
2M		-223.6	-902	-1585	-2246
3M			-678.4	-1361.4	-2022.4
6M				-683	-1344
9M					-661



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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)