

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-02-23】

今日 Fixing 定在 7.1064, 较上一交易日上调了 46 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 -21~-20.8 的位置, T/N 成交在 -7.1~-6.91 的位置, S/N 成交在 -7.12~-7.04 的位置。1w 成交在 -49.85, -49.8 的位置; 1s 成交在 -206.5, -205.5, -205 的位置; 2s 成交在 -447 的位置; 3s 成交在 -659.5, -658.2, -658 的位置; 4s 成交在 -447 的位置。

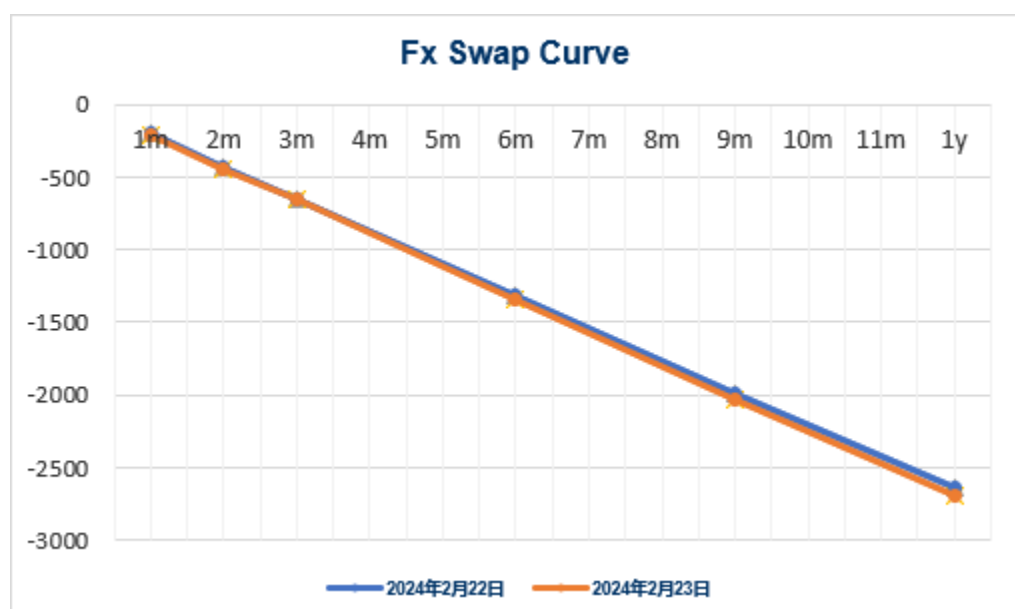
中长期, 6s 成交在 -1353, -1350, -1345, -1340, -1339 的位置; 9s 成交在 -2042, -2040 的位置; 1y 反复成交在 -2718, -2714, -2710, -2699, -2697, -2680 的位置。

超长, 18s 成交在 -3690 的位置; 2y 成交在 -4500 的位置; 3y 成交在 -5900 的位置。

Spread 上, 6s*1y 成交在 -1362, -1355, -1350 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.1934	-1.15
2W	14	-99	7.1885	-2
1M	29	-206	7.1778	-3.15
2M	62	-447	7.1537	-22
3M	91	-656	7.1328	-1.1
6M	182	-1338	7.0646	-20
9M	274	-2029	6.9955	-40
1Y	366	-2694	6.9291	-54
18M	547	-3700	6.8284	-75
2Y	731	-4500	6.7484	-130
3Y	1095	-5900	6.6084	-200
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1064	
CLOSING SPOT RATE			7.1984	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-241	-450	-1132	-1823	-2487.5
2M		-209	-891	-1582	-2246.5
3M			-682	-1373	-2037.5
6M				-691	-1355.5
9M					-664.5



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