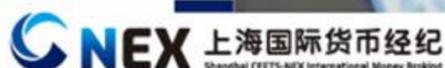


收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-03-07】

今日 Fixing 定在 7.1002, 较上一交易日上调了 14 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所上行。

短端, O/N 成交在 -7.1~-7.05 的位置, T/N 成交在 -21.2~-20.92 的位置, S/N 成交在 -7.05~-6.96 的位置。1w 成交在 -48.9, -48.6 的位置; 2w 成交在 -97.5 的位置; 1s 成交在 -216, -215.8, -215 的位置; 3s 成交在 -649, -648.5 的位置。

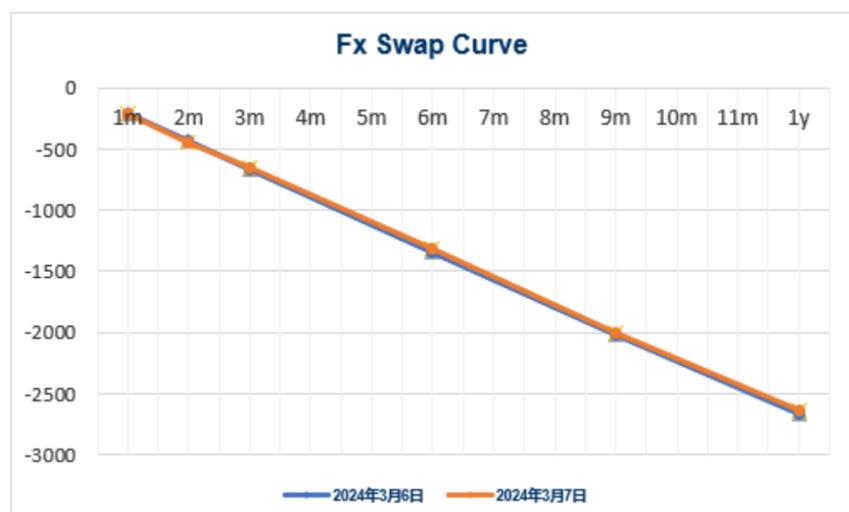
中长期, 6s 成交在 -1328, -1326, -1322 的位置; 9s 成交在 -2009, -2003 的位置; 1y 反复成交在 -2667, -2665, -2660, -2655, -2652 的位置。

超长期, 18s 成交在 -3680 的位置; 2y 成交在 -4400 的位置; 3y 成交在 -5740 的位置。

Spread 上, 1w*2w 成交在 -48.7 的位置; 1s*2s 成交在 -226.5 的位置; 2s*3s 成交在 -205 的位置; 6s*9s 成交在 -680 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1937	0.36
2W	14	-98	7.1888	1
1M	31	-216	7.1770	1.1
2M	63	-442	7.1544	-13
3M	92	-647	7.1339	24
6M	184	-1320	7.0666	16
9M	275	-1999	6.9987	15
1Y	365	-2638	6.9348	32
18M	549	-3670	6.8316	10
2Y	730	-4398	6.7588	42
3Y	1095	-5700	6.6286	85
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1002	
CLOSING SPOT RATE			7.1986	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-225.6	-431	-1104	-1783	-2422
2M		-205.4	-878.4	-1557.4	-2196.4
3M			-673	-1352	-1991
6M				-679	-1318
9M					-639



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