

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-04-10】

今日 Fixing 定在 7.0959，较上一交易日上调了 3 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~-6.9 的位置，T/N 成交在 -7.16~-7.12 的位置，S/N 成交在 -21.33~-21.3 的位置。1w 成交在 -49.9，-49.8，-49.73 的位置；2w 成交在 -99.5 的位置；1s 成交在 -223，-222.5 的位置；2s 成交在 -440.5 的位置；3s 成交在 -660，-657 的位置；4s 成交在 -888，-886 的位置。

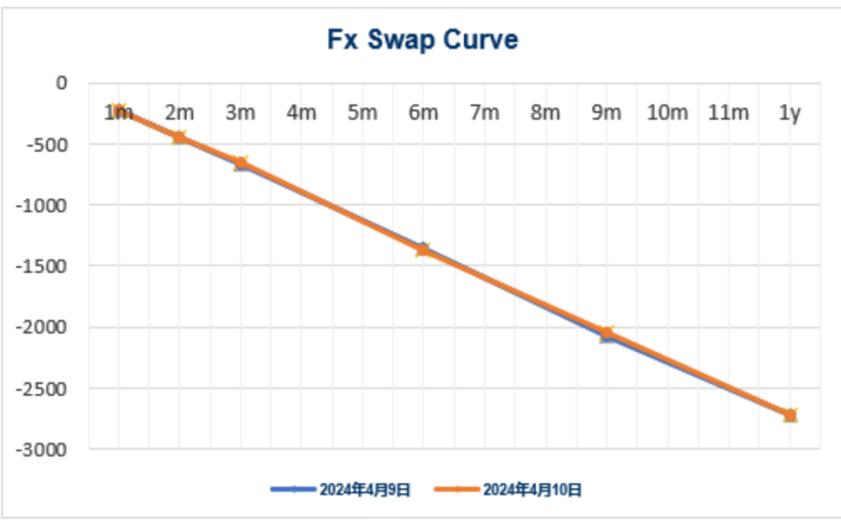
中长期，6s 成交在 -1368，-1365 的位置；9s 成交在 -2040，-2039 的位置；1y 反复成交在 -2721，-2717，-2715，-2710，-2705 的位置。

超长期，18s 成交在 -3760 的位置。

Spread 上，6s\*9s 成交在 -675 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2281	0.28
2W	14	-100	7.2232	0
1M	24	-223	7.2109	8
2M	61	-441	7.1891	1
3M	91	-659	7.1672	1.8
6M	186	-1368	7.0963	-13
9M	276	-2044	7.0287	25
1Y	367	-2719	6.9612	-2
18M	550	-3780	6.8551	31
2Y	731	-4550	6.7781	0
3Y	1095	-5700	6.6631	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0959	
CLOSING SPOT RATE			7.2331	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-218	-436.5	-1145.5	-1821.5	-2496.5
2M		-218.5	-927.5	-1603.5	-2278.5
3M			-709	-1385	-2060
6M				-676	-1351
9M					-675



文 / Edward Sun

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**