

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-03-19】

今日 Fixing 定在 7.0985，较上一交易日下调了 42 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 -7.16~-6.9 的位置，T/N 成交在 -7.21~-7.05 的位置，S/N 成交在 -7.19~-7.17 的位置。1w 成交在 -50.2, -50.18, -50.1, -50 的位置；1s 成交在 -231.7 的位置；3s 成交在 -667, -666.5, -666.2, -666 的位置。

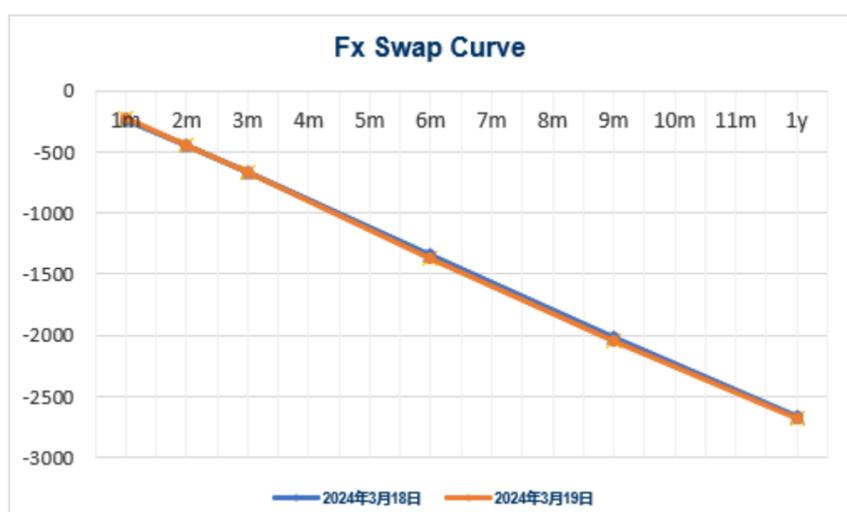
中长期，6s 成交在 -1365, -1364, -1363.5 的位置；9s 成交在 -2043, -2042 的位置；1y 反复成交在 -2675, -2674, -2673, -2672 的位置。

超长期，18s 成交在 -3715 的位置；2y 成交在 -4430 的位置；3y 成交在 -5700 的位置。

Spread 上，1s*3s 成交在 -435 的位置；9s*1y 成交在 -632 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.1943	0.17
2W	18	-129	7.1864	-29
1M	32	-231	7.1763	6.7
2M	61	-440	7.1553	-2
3M	92	-666	7.1327	-2.2
6M	186	-1363	7.0630	-18
9M	277	-2041	6.9952	-22
1Y	365	-2675	6.9318	-11
18M	550	-3715	6.8278	-25
2Y	732	-4430	6.7563	-45
3Y	1096	-5700	6.6293	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0985	
CLOSING SPOT RATE			7.1993	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-209.7	-435.7	-1132.5	-1810.5	-2444.5
2M		-226	-922.8	-1600.8	-2234.8
3M			-696.8	-1374.8	-2008.8
6M				-678	-1312
9M					-634



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