

# 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

【2024-03-05】

今日 Fixing 定在 7.1027, 较上一交易日下调了 7 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 -7.15~-7.09 的位置, T/N 成交在 -7.15~-7.1 的位置, S/N 成交在 -7.1~-7.09 的位置。1w 成交在 -49.15, -49.1 的位置; 2w 成交在 -97.9 的位置; 1s 成交在 -224, -223 的位置; 3s 成交在 -653, -652.5 的位置。

中长期, 6s 成交在 -1351, -1350, -1349, -1348 的位置; 9s 成交在 -2037, -2035, -2034 的位置; 1y 反复成交在 -2678, -2677, -2676, -2675, -2674, -2673 的位置。

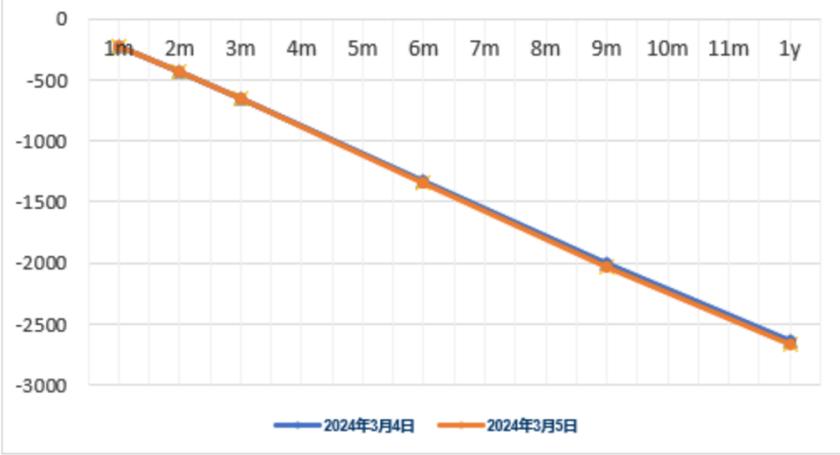
超长期, 18s 成交在 -3680 的位置; 2y 成交在 -4470, -4460 的位置; 3y 成交在 -5800 的位置。

Spread 上, 1s\*3s 成交在 -430 的位置; 6s\*9s 成交在 -687, -686, -685 的位置; 6s\*1y 成交在 -1327, -1323 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1942	-0.22
2W	14	-98	7.1893	0
1M	32	-223	7.1768	6.5
2M	61	-425	7.1566	3
3M	92	-652	7.1339	-3
6M	186	-1348	7.0644	-27
9M	277	-2031	6.9960	-33
1Y	365	-2669	6.9322	-25
18M	550	-3700	6.8291	-25
2Y	732	-4460	6.7531	-55
3Y	1096	-5800	6.6191	-75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1027	
CLOSING SPOT RATE			7.1991	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-201.87	-428.8	-1124.3	-1807.8	-2445.8
2M		-226.93	-922.43	-1605.93	-2243.93
3M			-695.5	-1379	-2017
6M				-683.5	-1321.5
9M					-638

### Fx Swap Curve



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