

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-03-26】

今日 Fixing 定在 7.0943，较上一交易日下调了 53 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 -7.2~-7 的位置，T/N 成交在 -7.3~-6.75 的位置，S/N 成交在 -7.3~-7.2 的位置。1w 成交在 -82.4, -82.3, -82, -81.5 的位置；2w 成交在 -103 的位置；1s 成交在 -235, -234.75 的位置；2s 成交在 -443 的位置；3s 成交在 -668, -667, -666.5, -666 的位置。

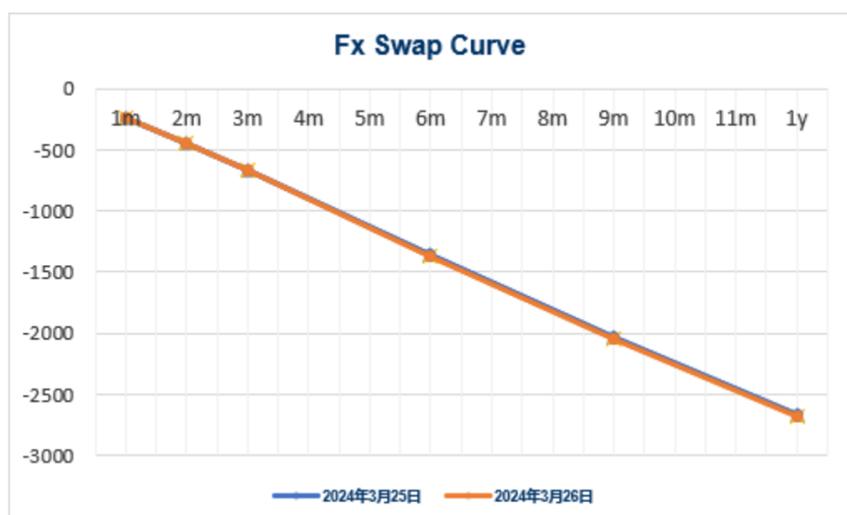
中长期，6s 成交在 -1366, -1365 的位置；9s 成交在 -2053 的位置；1y 反复成交在 -2687, -2685, -2684, -2683, -2680, -2677, -2674 的位置。

超长期限，3y 成交在 -5620 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -21.7 的位置；6s*9s 成交在 -684 的位置；3s*1y 成交在 -2007 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	11	-82	7.2112	-30.68
2W	14	-104	7.2091	-2
1M	32	-233	7.1961	5.7
2M	61	-444	7.1750	6
3M	92	-667	7.1527	1.4
6M	186	-1365	7.0829	-15
9M	277	-2047	7.0147	-22
1Y	365	-2678	6.9516	-18
18M	550	-3660	6.8534	0
2Y	732	-4405	6.7789	-5
3Y	1096	-5655	6.6539	-25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0943	
CLOSING SPOT RATE			7.2194	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-210.64	-433.2	-1131.6	-1813.6	-2444.6
2M		-222.56	-920.96	-1602.96	-2233.96
3M			-698.4	-1380.4	-2011.4
6M				-682	-1313
9M					-631



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