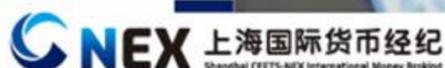


收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-02-20】

今日 Fixing 定在 7.1068，较上一交易日上调了 36 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

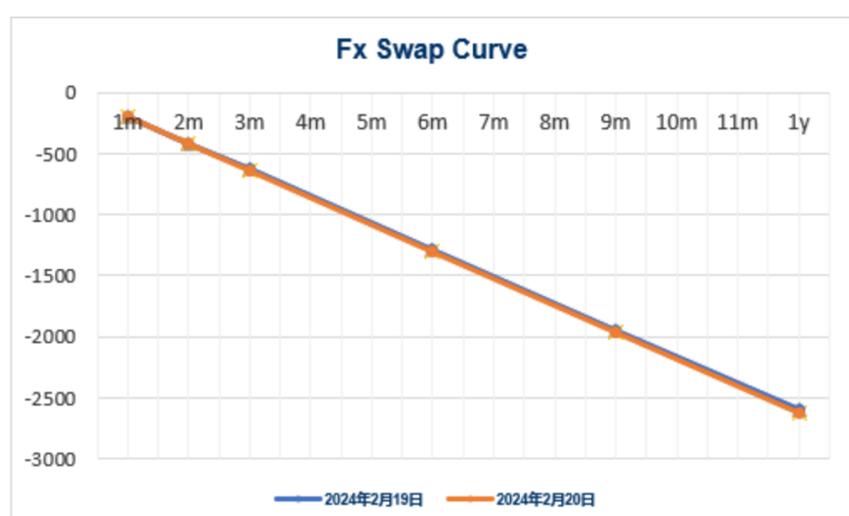
短端，O/N 成交在 -6.5~-6.2 的位置，T/N 成交在 -6.52~-6.35 的位置，S/N 成交在 -6.5~-6.46 的位置。1w 成交在 -46，-46.4，-46.6 的位置；2w 成交在 -95，-94.4 的位置；1s 成交在 -196.5，-197.5，-197 的位置；2s 成交在 -417 的位置；3s 成交在 -628，-632，-631 的位置。

中长期，6s 成交在 -1295，-1297，-1300 的位置；9s 成交在 -1958，-1957，-1960 的位置；1y 反复成交在 -2620，-2615，-2617，-2618，-2616，-2610 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -47.8 的位置；9s*1y 成交在 -657，-658 的位置；6s*1y 成交在 -1322 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-47	7.1929	-0.04
2W	14	-94	7.1882	-1
1M	29	-198	7.1778	-2
2M	60	-417	7.1559	4
3M	90	-632	7.1344	-3.9
6M	182	-1302	7.0674	-12
9M	274	-1965	7.0011	-13
1Y	368	-2623	6.9353	-28
18M	547	-3565	6.8411	-30
2Y	732	-4305	6.7671	-5
3Y	1096	-5500	6.6476	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1068	
CLOSING SPOT RATE			7.1976	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-219.7	-434.2	-1104.3	-1767.3	-2425.3
2M		-214.5	-884.6	-1547.6	-2205.6
3M			-670.1	-1333.1	-1991.1
6M				-663	-1321
9M					-658



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