

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-02-07】

今日美元/人民币中间价报 7.1049，较上一个交易日下调 33bp，各期限收盘价较上一交易日略微下降。

ON 从-6.4 给到-6.65，后买回-6.5；TN 从-6.5 一路买到-6.3，又给回-6.42，午后买回-6.38 附近；今日 SN 同 1W。1W 在-74~-71 之间来回成交，尾盘收在-71.1；2W 成交在-91.5~-90.7 之间。1S 成交在-205~-203 之间，尾盘收在-205.1；2S 成交在-408 附近；3S 成交在-618~-617 之间。

中长期，6S 成交在-1250 附近；9S 成交在-1893~-1892 之间；1Y 从-2476 给到-2480，午后从-2485 给到-2489、2493、-2494、-2496、-2496.5、-2505，尾盘收在-2500。

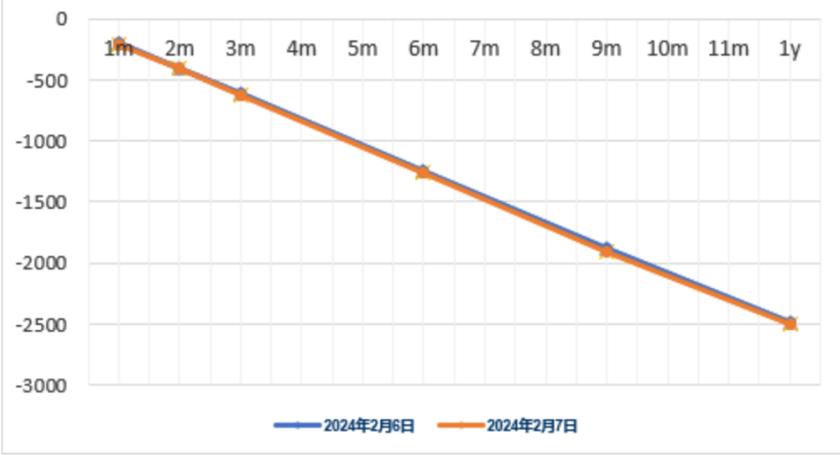
超长期，18S 成交在-3395。

Spread 方面，1W*2W 成交在-19.5、-19.8，1W*1S 成交在-133.7、-133.8，1*2S 成交在-203，6*12S 成交在-1229、-1241。

| Tenor | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W | 11 | -71 | 7.1860 | 8.1 |
| 2W | 14 | -91 | 7.1840 | 2 |
| 1M | 31 | -205 | 7.1726 | -12.3 |
| 2M | 60 | -408 | 7.1523 | 1 |
| 3M | 90 | -618 | 7.1313 | -0.8 |
| 6M | 182 | -1254 | 7.0677 | -5 |
| 9M | 277 | -1905 | 7.0026 | -30 |
| 1Y | 367 | -2505 | 6.9426 | -16 |
| 18M | 549 | -3395 | 6.8536 | 5 |
| 2Y | 731 | -4075 | 6.7856 | 25 |
| 3Y | 1099 | -5250 | 6.6681 | 25 |
| CNY CENTRAL PARITY RATE | | | 7.1049 | |
| CLOSING SPOT RATE | | | 7.1931 | |

| USD/CNY Spread Ref. | | | | | |
|---------------------|--------|--------|---------|---------|---------|
| | 2M | 3M | 6M | 9M | 1Y |
| 1M | -202.7 | -412.7 | -1048.7 | -1699.7 | -2299.7 |
| 2M | | -210 | -846 | -1497 | -2097 |
| 3M | | | -636 | -1287 | -1887 |
| 6M | | | | -651 | -1251 |
| 9M | | | | | -600 |

Fx Swap Curve



文 / Cathy He

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