

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

【2024-03-08】

今日 Fixing 定在 7.0978，较上一交易日上调了 24 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

短端，O/N 成交在 -21.5~-20.75 的位置，T/N 成交在 -7.04~-6.8 的位置，S/N 成交在 -6.98~-6.8 的位置。1w 成交在 -48.5，-48.4 的位置；2w 成交在 -97.2 的位置；1s 成交在 -214.2，-214 的位置；2s 成交在 -432，-431，-430 的位置；3s 成交在 -643 的位置。

中长期，6s 成交在 -1316，-1315，-1312 的位置；9s 成交在 -1987，-1986 的位置；1y 反复成交在 -2626，-2620，-2618，-2617，-2611 的位置。

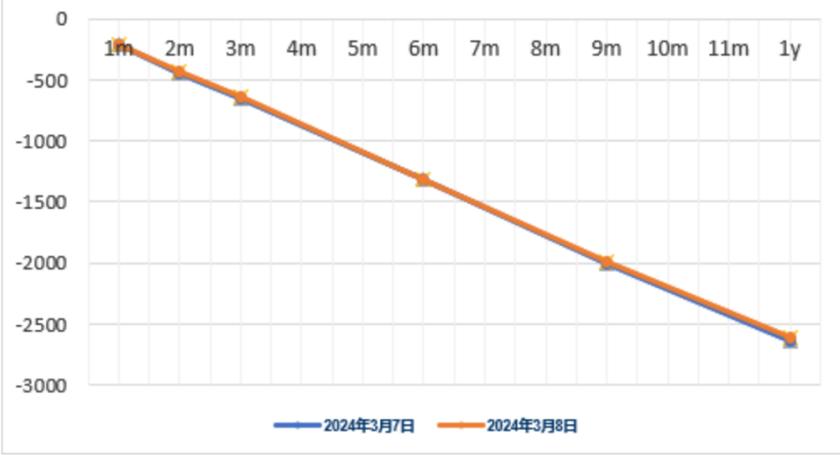
超长期，18s 成交在 -3610，-3600 的位置；2y 成交在 -4320，-4310 的位置。

Spread 上，1s*2s 成交在 -216.8 的位置；3s*6s 成交在 -669 的位置；2s*9s 成交在 -1557 的位置；1y*2y 成交在 -1692 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1870	0.35
2W	14	-97	7.1821	1
1M	31	-214	7.1704	1.55
2M	62	-430	7.1488	12
3M	92	-642	7.1276	5
6M	184	-1313	7.0605	7
9M	275	-1983	6.9935	16
1Y	365	-2614	6.9304	24
18M	549	-3600	6.8318	70
2Y	730	-4300	6.7618	98
3Y	1095	-5600	6.6318	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0978	
CLOSING SPOT RATE			7.1918	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-215.55	-427.55	-1098.55	-1768.55	-2399.55
2M		-212	-883	-1553	-2184
3M			-671	-1341	-1972
6M				-670	-1301
9M					-631

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