

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-05-08】

今日 Fixing 定在 7.1016, 较上一交易日下调了 14 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所下行。

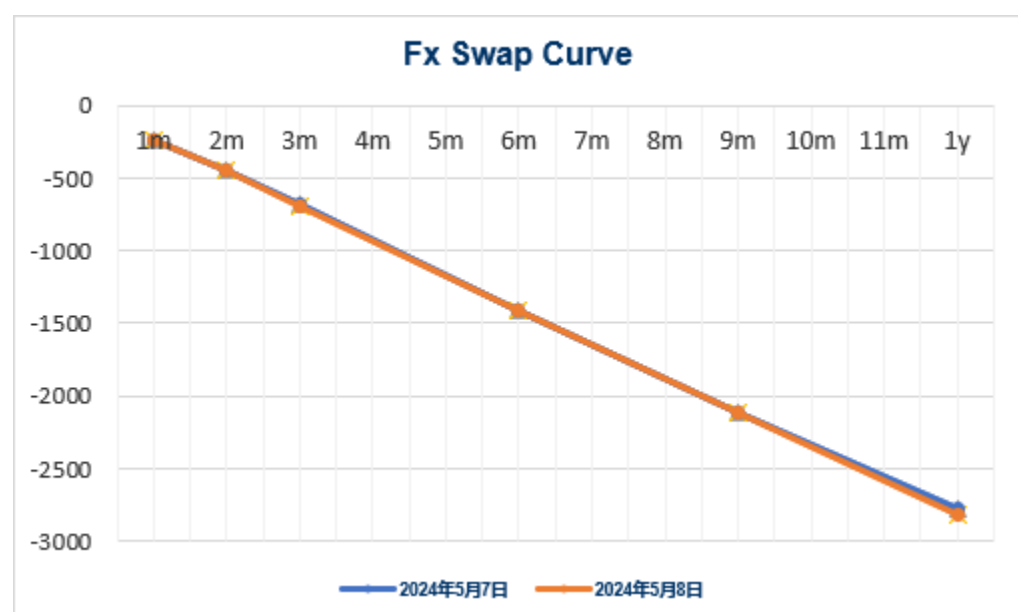
短端, O/N 成交在 -7~-6.5 的位置, T/N 成交在 -6.91~-6.68 的位置, S/N 成交在 -20.95~-20.27 的位置。1w 成交在 -49, -48.5 的位置; 1s 成交在 -232.3, -231, -230 的位置; 2s 成交在 -448 的位置; 3s 成交在 -696 的位置。

中长期, 6s 成交在 -1410, -1408, -1407, -1405, -1404 的位置; 9s 成交在 -2118, -2116, -2114, -2112, -2111, -2110 的位置; 1y 反复成交在 -2817, -2816, -2815, -2814, -2810, -2809, -2805, -2800 的位置。

Spread 上, 1s*2s 成交在 -215 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.2212	-0.3
2W	14	-99	7.2162	-1
1M	32	-232	7.2029	3.5
2M	61	-448	7.1813	-4
3M	94	-696	7.1565	-21.8
6M	186	-1410	7.0851	-4
9M	276	-2120	7.0141	-9
1Y	367	-2820	6.9441	-39
18M	549	-3950	6.8311	0
2Y	731	-4775	6.7486	-20
3Y	1095	-5935	6.6326	-60
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1016	
CLOSING SPOT RATE			7.2261	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-215.6	-463.6	-1177.6	-1887.6	-2587.6
2M		-248	-962	-1672	-2372
3M			-714	-1424	-2124
6M				-710	-1410
9M					-700



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