

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-05-17】

今日 Fixing 定在 7.1045，较上一交易日下调了 25 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 -23~-22.3 的位置，T/N 成交在 -7.6~-7.42 的位置，S/N 成交在 -7.48~-7.45 的位置。1w 今日开盘在 -52.5 位置，随后一路走高，最低成交在 -51.5 的位置；1s 今日成交较少，反复成交在 -232.5 的位置；2s 成交在 -471 的位置；3s 成交较少，主要成交在 -704.5 的位置。

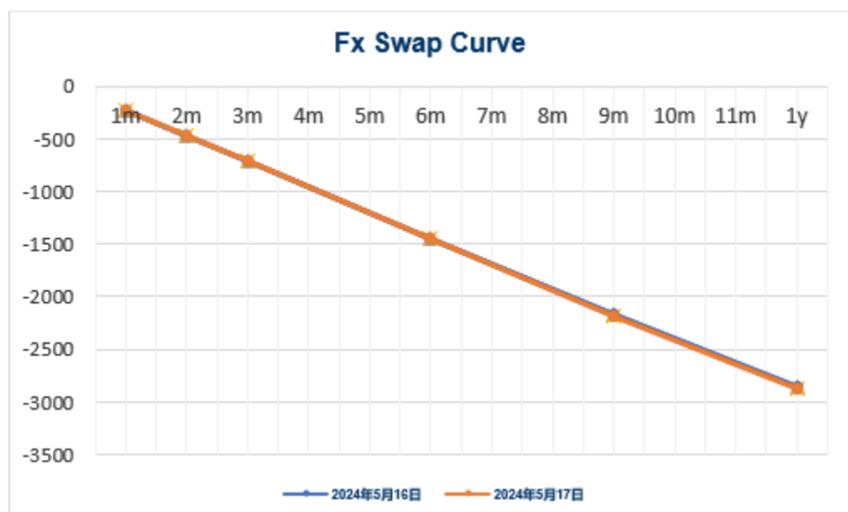
中长期，6s 成交较少，成交价格在 -1451，-1450 附近位置；9s 成交在 -2190，-2184 的位置，成交寥寥；1y 成交较为活跃，开盘在 -2883 的位置，随后一路下跌，最低在 -2900 的位置，午盘之后开始回升至 -2885 处，尾盘回升至 -2878 的位置。

超长期，2y 有部分成交，位置在 -4880，-4850 的位置；3y 成交在 -5900 的位置。

Spread 上，9s*1y 成交在 -688 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2190	7.5
2W	14	-104	7.2138	0
1M	31	-232	7.2010	0.5
2M	62	-471	7.1772	6
3M	92	-706	7.1536	-1
6M	184	-1447	7.0796	-1
9M	276	-2183	7.0059	-8
1Y	365	-2872	6.9370	-10
18M	549	-4005	6.8237	5
2Y	730	-4890	6.7352	-65
3Y	1095	-5920	6.6322	80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1045	
CLOSING SPOT RATE			7.2242	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-238.5	-474	-1214.5	-1951	-2640
2M		-235.5	-976	-1712.5	-2401.5
3M			-740.5	-1477	-2166
6M				-736.5	-1425.5
9M					-689



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