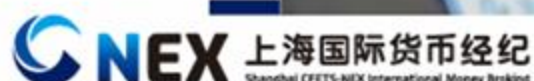


收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-04-24】

今日 Fixing 定在 7.1048, 较上一交易日上调了 11 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所下行。

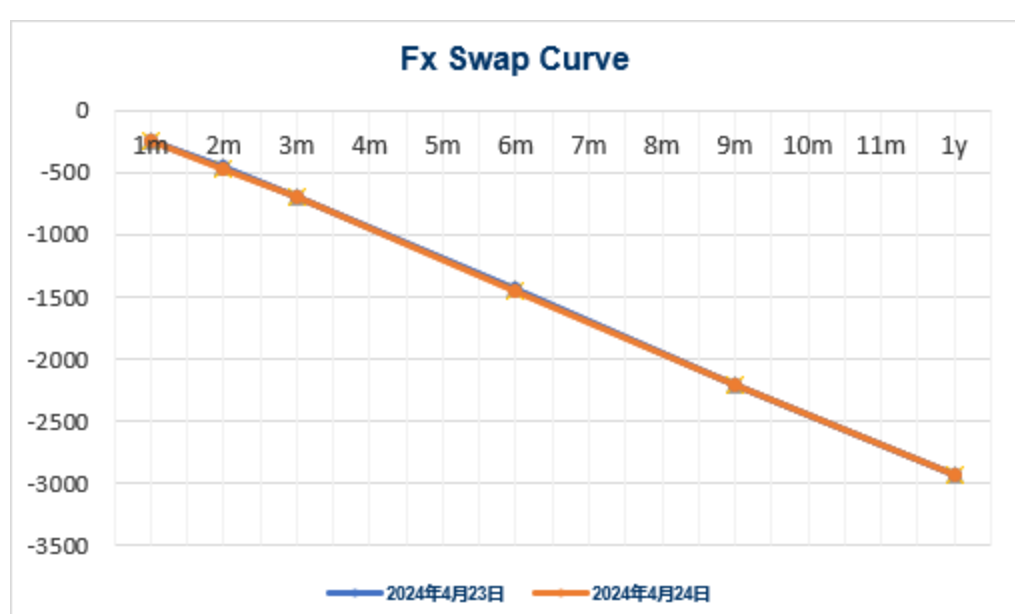
短端, O/N 成交在 -8~-7.4 的位置, T/N 成交在 -8~-7.3 的位置, S/N 成交在 -23.7~-22.5 的位置。1w 成交在 -80.5, -80 的位置; 2w 成交在 -111, -108 的位置; 1s 成交在 -251, -249 的位置; 2s 成交在 -478 的位置; 3s 成交在 -707, -706, -705, -704 的位置。

中长期, 6s 成交在 -1465, -1460 的位置; 9s 成交在 -2270, -2265, -2260, -2255 的位置; 1y 反复成交在 -3000, -2979, -2975, -2970, -2965, -2960, -2953 的位置。

超长期, 18s 成交在 -4200 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	10	-80	7.2380	3.1
2W	14	-111	7.2349	-6
1M	32	-250	7.2210	-1.2
2M	61	-474	7.1987	-13
3M	91	-704	7.1756	-12
6M	185	-1459	7.1001	-17
9M	276	-2210	7.0250	5
1Y	367	-2938	6.9522	-3
18M	549	-4150	6.8310	-10
2Y	731	-5010	6.7450	70
3Y	1095	-6350	6.6110	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1048	
CLOSING SPOT RATE			7.2460	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-223.8	-454.3	-1209.3	-1960.3	-2688.3
2M		-230.5	-985.5	-1736.5	-2464.5
3M			-755	-1506	-2234
6M				-751	-1479
9M					-728



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