

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

【2024-08-15】

今日 Fixing 定在 7.1399，较上一交易日下调了 16 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 -7.2~-6.7 的位置；T/N 成交在 -22.4~-21.7 的位置；S/N 成交在 -7.37~-7.28 的位置。1w 成交在 -53，-52.8，-52.6 的位置；2w 成交在 -117 的位置；1s 成交在 -250 的位置；2s 成交在 -503 的位置；3s 成交在 -730,-726 的位置；4s 成交在 -950 的位置；5s 成交在 -1187 的位置。

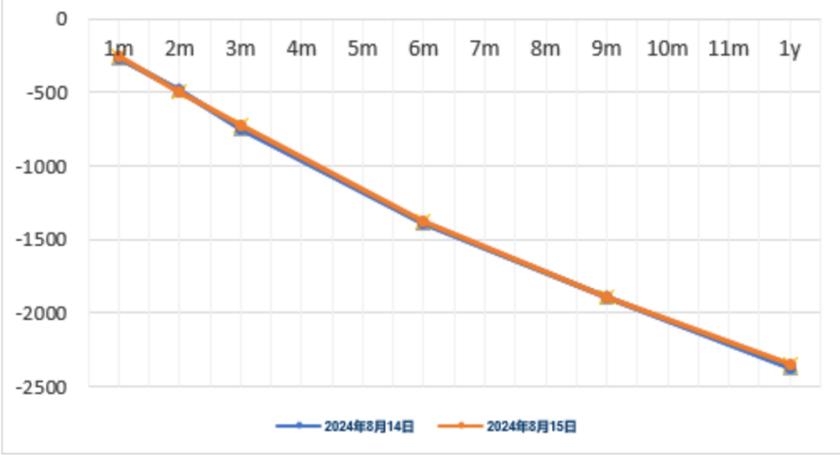
中长期，6s 成交在 -1392，-1390，-1375 的位置；1y 成交在 -2390，-2380，-2370，-2358 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -64 的位置；9s*1y 成交在 -465 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1558	-0.4
2W	15	-119	7.1493	-12
1M	31	-252	7.1360	12.4
2M	63	-500	7.1111	-11
3M	92	-729	7.0882	13
6M	184	-1380	7.0231	10
9M	273	-1897	6.9714	-2
1Y	365	-2356	6.9255	18
18M	553	-3100	6.8511	75
2Y	730	-3800	6.7811	50
3Y	1095	-4800	6.6811	20
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1399	
CLOSING SPOT RATE			7.1611	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-248.5	-477.5	-1128.5	-1645.5	-2104.5
2M		-229	-880	-1397	-1856
3M			-651	-1168	-1627
6M				-517	-976
9M					-459

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:

以上所提及的所有信息（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