

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-07-23】

今日 Fixing 定在 7.1334, 较上一交易日上调了 1 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 -8.9~-8 的位置; T/N 成交在 -8.42~-8.35 的位置; S/N 成交在 -8.45~-8.35 的位置。3w 成交在 -172.7 的位置; 1s 成交在 -263.5, -263.1, -262.9 的位置; 3s 成交在 -756, -755.2 的位置。

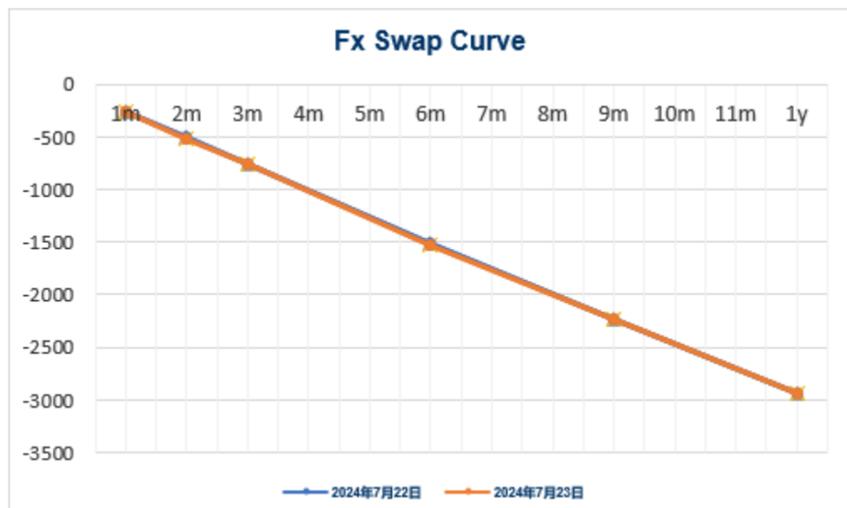
中长期, 6s 成交主要成交 -1531.5 的位置; 9s 成交在 -2234, -2233 的位置; 1y 今日成交较多, 开盘在 -2940 的位置, 随后一路走低, 较多成交在 -2945, -2944, -2940 的位置, 尾盘收在 -2944 的位置。

超长期, 18s 成交在 -4115, -4110 的位置。

Spread 上, 1s*2s 成交在 -247, -246 的位置; 3s*6s 成交在 -776, -775.5 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-58	7.2683	-0.69
2W	14	-116	7.2626	-1
1M	32	-263	7.2478	6
2M	62	-510	7.2231	-5
3M	92	-756	7.1985	-6.06
6M	186	-1532	7.1209	-24
9M	274	-2232	7.0509	-4
1Y	365	-2943	6.9798	-3
18M	550	-4110	6.8631	0
2Y	732	-5000	6.7741	-10
3Y	1096	-6140	6.6601	10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1334	
CLOSING SPOT RATE			7.2741	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-247	-493.06	-1269	-1969	-2680
2M		-246.06	-1022	-1722	-2433
3M			-775.94	-1475.94	-2186.94
6M				-700	-1411
9M					-711



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