

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

【2024-09-13】

今日 Fixing 定在 7.1030, 较上一交易日上调了 184 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 -38.5~-36.55 的位置; T/N 成交在 -7.59~-7.42 的位置; S/N 成交在 -7.65~-7.4 的位置。1w 成交在 -52.6, -52.5, -51.9, -51.7 的位置; 3w 成交在 -152.1 的位置; 3s 成交在 -635, -629, -628, -621 的位置; 4s 成交在 -825, -820, -810, -808 的位置。

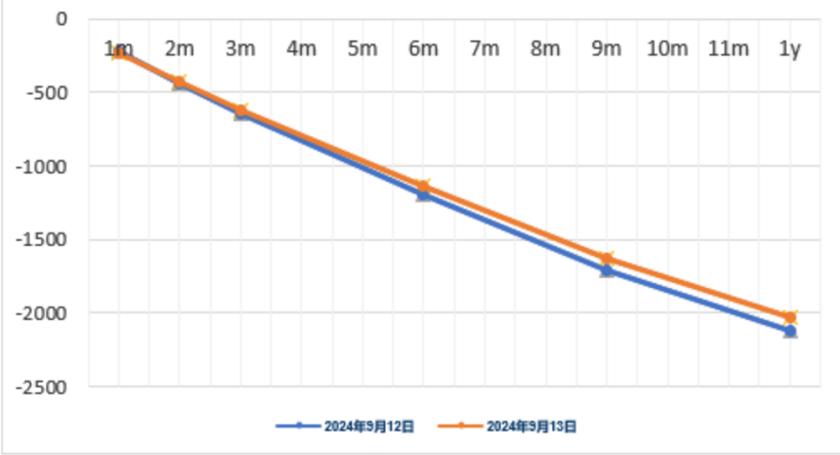
中长期限, 6s 成交在 -1153, -1152, -1150, -1145, -1143 的位置; 9s 成交在 -1645, -1637, -1630 的位置; 1y 成交在 -2055, -2050, -2040, -2035, -2035, -2015 的位置。

Spread 上, 1w*2w 成交在 -88 的位置; 6s*1y 成交在 -899, -866 的位置; 3s*4s 成交在 -195 的位置; 3s*6s 成交在 -523 的位置; 6s*9s 成交在 -497 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.0893	2.09
2W	19	-137	7.0806	13
1M	32	-227	7.0716	-7
2M	61	-426	7.0517	16
3M	91	-621	7.0322	19.8
6M	181	-1142	6.9801	53
9M	274	-1632	6.9311	73
1Y	365	-2032	6.8911	89
18M	546	-2560	6.8383	110
2Y	732	-2950	6.7993	125
3Y	1096	-3895	6.7048	80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1030	
CLOSING SPOT RATE			7.0943	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-199	-394	-915	-1405	-1805
2M		-195	-716	-1206	-1606
3M			-521	-1011	-1411
6M				-490	-890
9M					-400

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