

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-08-19】

今日 Fixing 定在 7.1415, 较上一交易日上调了 49 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 -7.3~-7 的位置; T/N 成交在 -7.57~-7.35 的位置; S/N 成交在 -7.49~-7.48 的位置。1w 成交在 -53.4, -53.3 的位置; 1s 成交在 -266.5, -266, -264 的位置; 3s 成交在 -730, -729.5, -729 的位置; 4s 成交在 -950 的位置。

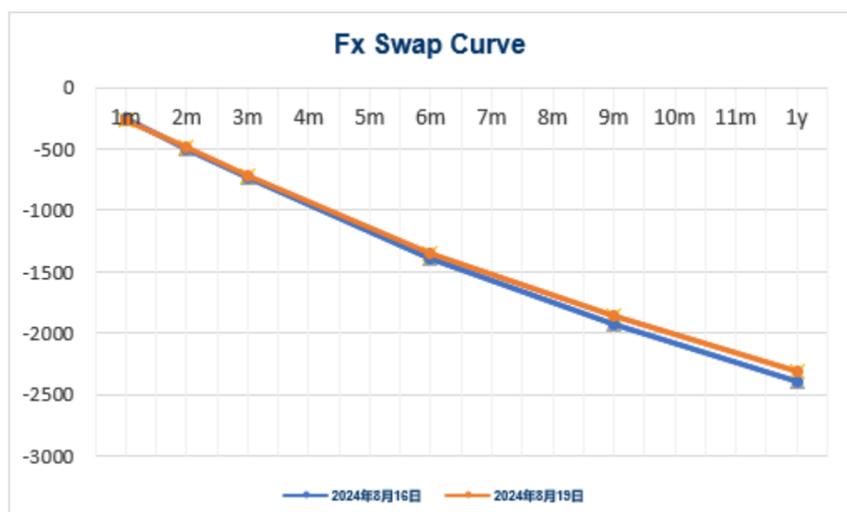
中长期限, 6s 成交在 -1372, -1369, -1355 的位置; 9s 成交在 -1900 的位置; 1y 成交在 -2355, -2346, -2337, -2335 的位置。

超长期限, 18s 成交在 -3010 的位置。

Spread 上, 1s\*3s 成交在 -463 的位置; 6s\*1y 成交在 -973 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1330	0.15
2W	14	-110	7.1273	2
1M	33	-264	7.1119	-11.7
2M	61	-486	7.0897	18
3M	92	-720	7.0663	10
6M	184	-1355	7.0028	38
9M	273	-1861	6.9522	65
1Y	365	-2308	6.9075	92
18M	551	-3000	6.8383	130
2Y	730	-3650	6.7733	150
3Y	1097	-4760	6.6623	70
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1415	
CLOSING SPOT RATE			7.1383	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-222.3	-456.3	-1091.3	-1597.3	-2044.3
2M		-234	-869	-1375	-1822
3M			-635	-1141	-1588
6M				-506	-953
9M					-447



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**