

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

【2024-04-01】

今日 Fixing 定在 7.0938，较上一交易日上调了 12 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 -6.9~-6.8 的位置，T/N 成交在 -6.78~-6.69 的位置，S/N 成交在 -34.1~-33.85 的位置。1w 成交在 -47.9，-47.75 的位置；2w 成交在 -97 的位置；3w 成交在 -145.8 的位置；1s 成交在 -229，-228.5 的位置；3s 成交在 -646，-644 的位置。

中长期，6s 成交在 -1363，-1362 的位置；9s 成交在 -2016，-2015，-2013 的位置；1y 反复成交在 -2669，-2667，-2666 的位置。

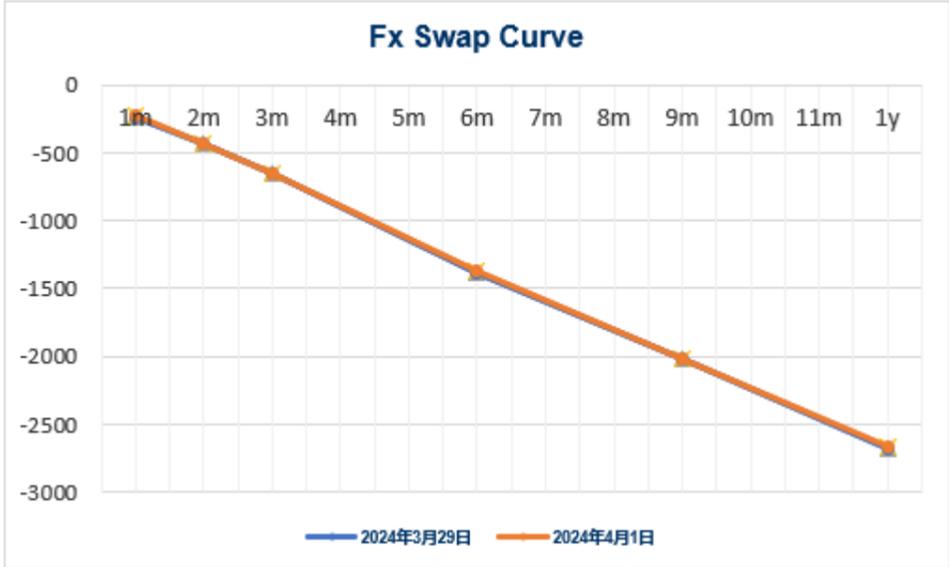
超长期限，2y 成交在 -4400 的位置。

Spread 上，2w*2s 成交在 -332 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-97	7.2196	-48.6
2W	14	-147	7.2146	-50
1M	33	-229	7.2064	6.95
2M	61	-429	7.1864	9
3M	91	-646	7.1647	3
6M	188	-1363	7.0930	14
9M	275	-2015	7.0278	6
1Y	365	-2670	6.9624	6
18M	554	-3710	6.8583	20
2Y	730	-4410	6.7883	17
3Y	1098	-5575	6.6718	-25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0938	
CLOSING SPOT RATE			7.2293	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-199.85	-416.85	-1133.85	-1785.85	-2440.35
2M		-217	-934	-1586	-2240.5
3M			-717	-1369	-2023.5

6M				-652	-1306.5
9M					-654.5



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