

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-04-16】

今日 Fixing 定在 7.1028，较上一交易日下调了 49 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

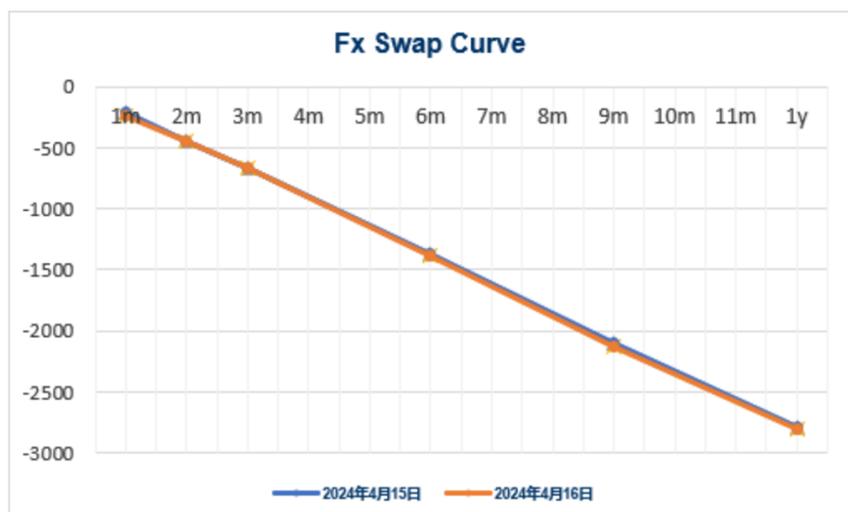
短端，O/N 成交在 -7.45~-7.1 的位置，T/N 成交在 -7.25~-7.1 的位置，S/N 成交在 -7.2~-7.1 的位置。1w 成交在 -50.4, -50.3 的位置；2w 成交在 -130.5 的位置；1s 成交在 -233, -232.5, -232.3, -232, -231.5 的位置；2s 成交在 -446, -445, -444, -443.7 的位置；3s 成交在 -676, -675, -674 的位置。

中长期，6s 成交在 -1380, -1379, -1378.5 的位置；9s 成交在 -2125, -2124 的位置；1y 反复成交在 -2811, -2810, -2808, -2805, -2804, -2803 的位置。

Spread 上，1w*1s 成交在 -182 的位置；2w*2s 成交在 -315 的位置；1s*2s 成交在 -214 的位置；2s*3s 成交在 -228 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2346	-0.6
2W	18	-130	7.2266	6
1M	32	-234	7.2163	-16.2
2M	61	-446	7.1950	-2
3M	91	-672	7.1724	-4
6M	183	-1380	7.1016	-4
9M	278	-2126	7.0270	-28
1Y	365	-2806	6.9590	-10
18M	550	-3975	6.8421	-25
2Y	732	-4820	6.7576	-50
3Y	1096	-6055	6.6341	-110
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1028	
CLOSING SPOT RATE			7.2396	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-212.5	-438.5	-1146.1	-1892.5	-2572.5
2M		-226	-933.6	-1680	-2360
3M			-707.6	-1454	-2134
6M				-746.4	-1426.4
9M					-680



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