

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-05-10】

今日 Fixing 定在 7.1011，较上一交易日上调了 17 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

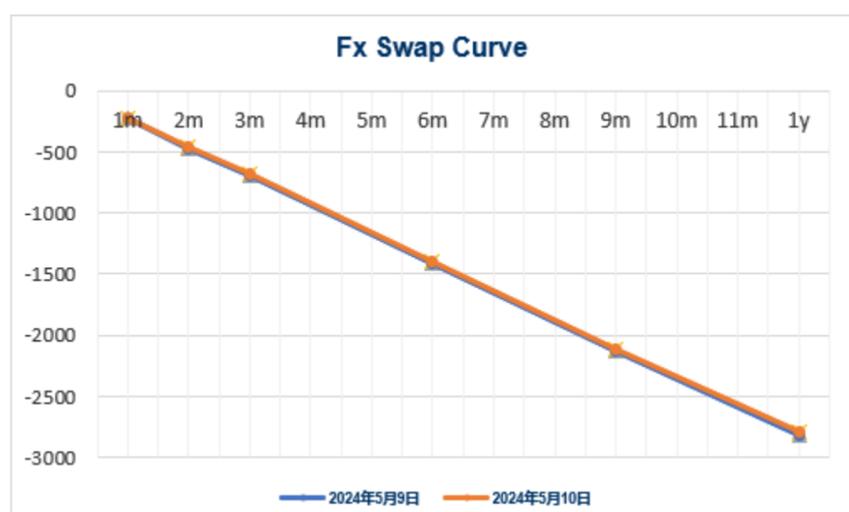
短端，O/N 成交在 -21.2~-21 的位置，T/N 成交在 -7.1~-6.96 的位置，S/N 成交在 -7.1~-6.98 的位置。1w 开盘成交在 -49.35 的位置，随后价格下降，最低成交在 -49.4；2w 成交较少，成交在 -99.4 的位置；1s 开盘在 -223 的位置，随后在 -223~-222 位置成交，最高成交在 -222.6 的位置；2s 成交在 -455~-452 的位置；3s 开盘在 -682，最低成交在 -684。

中长期，6s 成交较少，成交价格在 -1397 附近位置；9s 成交较多，开盘在 -2115 的位置，随后在 -2115~-2110 之间来回成交，最后成交在 -2113 位置；1y 成交较为活跃，开盘较低在 -2810 的位置，最后一路买至 -2792 处，尾盘开始回落，最后收盘在 -2795 的位置。

Spread 上，2s*3s 成交在 -229 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.2197	0.8
2W	14	-99	7.2147	9
1M	31	-223	7.2023	4.6
2M	62	-455	7.1791	13
3M	92	-683	7.1564	5.5
6M	184	-1396	7.0850	11
9M	276	-2115	7.0131	15
1Y	365	-2794	6.9452	24
18M	549	-3910	6.8336	70
2Y	730	-4750	6.7496	75
3Y	1095	-5850	6.6396	175
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1011	
CLOSING SPOT RATE			7.2246	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-231.6	-459.4	-1172.9	-1891.9	-2570.9
2M		-227.8	-941.3	-1660.3	-2339.3
3M			-713.5	-1432.5	-2111.5
6M				-719	-1398
9M					-679



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