

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

【2024-05-29】

今日 Fixing 定在 7.1106，较上一交易日下调了 5 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 -7.9~-7.3 的位置；T/N 成交在 -8.1~-7.32 的位置，S/N 成交在 -23.6~-22.4 的位置。1w 今日成交较为活跃，开盘在 -51.9 位置，后来大量成交在 -53 的位置；2w 成交在 -104.7 的位置附近；3w 成交在 -158 的位置；2s 今日成交在 -464，-463.5 的位置；3s 开盘在 -702 的位置，大量成交在 -702 的位置；4s 成交在 -951 位置附近；5s 成交在 -1208 的位置。

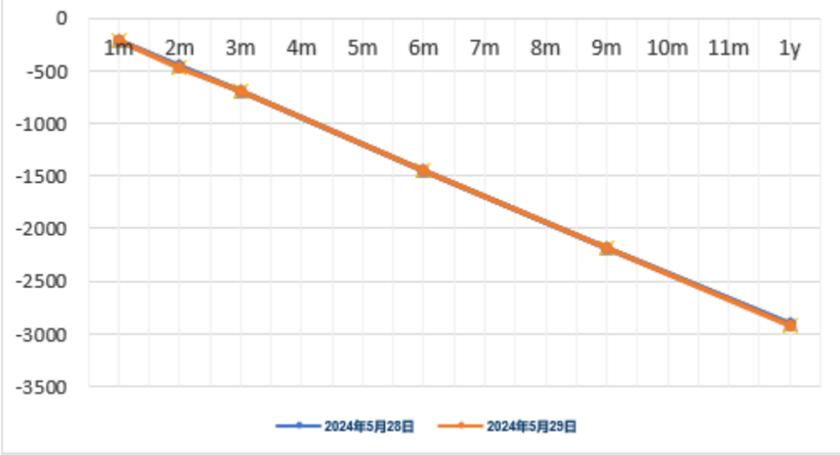
中长期，6s 成交较多，主要成交在 -1449，-1448 的位置；9s 成交在 -2205，-2201.2，-2195 的位置；1y 成交较为活跃，大量成交在 -2930，-2926 的位置。

Spread 上，6s*9s 成交在 -753 的位置；1w*2w 成交在 -52.2 的位置；3s*6s 成交在 -746 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-54	7.2434	-2.3
2W	14	-106	7.2381	-3
1M	28	-211	7.2276	2.8
2M	61	-464	7.2023	-6
3M	91	-702	7.1785	-0.9
6M	182	-1445	7.1042	-3
9M	273	-2192	7.0295	-6.5
1Y	364	-2917	6.9570	-13
18M	546	-4115	6.8372	-49
2Y	728	-4990	6.7497	-34
3Y	1092	-6115	6.6372	-65
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1106	
CLOSING SPOT RATE			7.2487	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-253.1	-491	-1234.3	-1981.3	-2706.3
2M		-237.9	-981.2	-1728.2	-2453.2
3M			-743.3	-1490.3	-2215.3
6M				-747	-1472
9M					-725

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