

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-NIX International Money Broking

【2024-10-10】

今日 Fixing 定在 7.0742, 较上一交易日上升了 174 个 bp。今日各期限交投较活跃。

短端, O/N 主要成交在-6.7~-5.7。 T/N 主要成交在-24~-21 的位置。 S/N 主要成交在-6~-5.3 的位置。 1w 成交在-41, -40.5, -39.5 等位置。 2w 成交在-82 的位置。 3w 成交在-123.5 的位置。 1s 成交在-188, -185, -181 等位置。 2s 成交在-360, -359 等位置。 3s 成交在-528, -526, -525, -523, -520, -519.5 等位置。 4s 成交在-702, -703 等位置。 5s 成交在-844, -841, -840, -845 等位置。

中长期, 6s 成交在-995, -992, -990, -988, -987, -985, -983, -987, -989, -990, -992, -995 等位置。 9s 成交在-1460, -1455, -1450, -1438, -1445, -1455 等位置。 1y 成交在-1850, -1852, -1855, -1858, -1860, -1865, -1870 等位置。

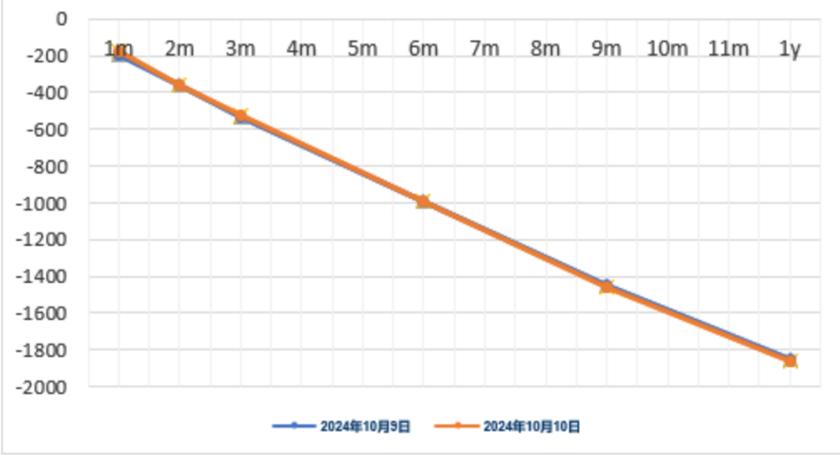
超长期, 2y 成交在-2850 的位置。 3y 成交在-3620, -3610 的位置。

Spread 方面, 4*5s 成交在-137 的位置。 6*9s 成交在-454 的位置。 6*12s 成交在-875, -870 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.0747	1.6
2W	14	-82	7.0705	0
1M	31	-181	7.0606	11
2M	62	-358	7.0429	2
3M	92	-521	7.0266	16
6M	182	-995	6.9792	-1
9M	273	-1460	6.9327	-11
1Y	365	-1865	6.8922	-8
18M	547	-2457	6.8330	18
2Y	730	-2850	6.7937	20
3Y	1095	-3650	6.7137	-75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0742	
CLOSING SPOT RATE			7.0787	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-177	-340	-814	-1279	-1684
2M		-163	-637	-1102	-1507
3M			-474	-939	-1344
6M				-465	-870
9M					-405

Fx Swap Curve



文 / Yiff Wang

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