

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

【2024-04-11】

今日 Fixing 定在 7.0968，较上一交易日上调了 9 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 -7.1~-6.9 的位置，T/N 成交在 -21.7~-21.4 的位置，S/N 成交在 -7.2~-7.1 的位置。1w 成交在 -50.15, -49.96, -49.8 的位置；2w 成交在 -100.2, -100 的位置；1s 成交在 -217.8, -217.5 的位置；3s 成交在 -668, -667.5 的位置；5s 成交在 -1160 的位置。

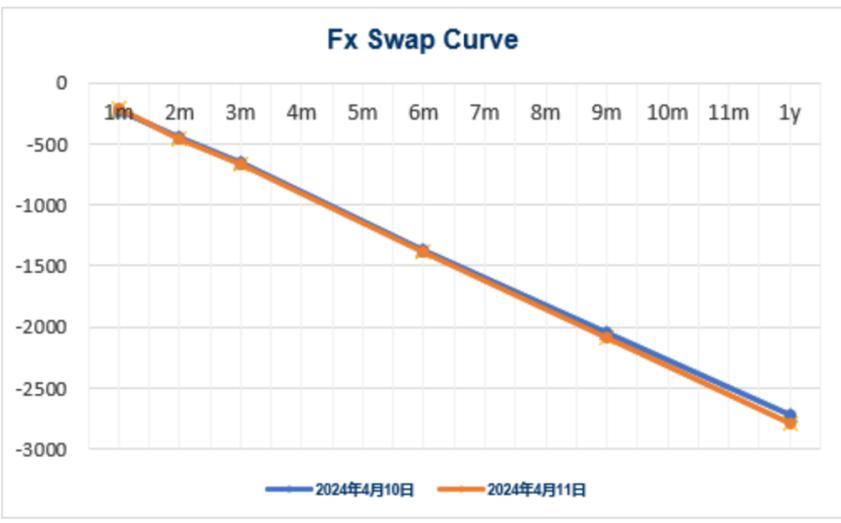
中长期，6s 成交在 -1377, -1375, -1370 的位置；9s 成交在 -2100, -2095, -2090 的位置；1y 反复成交在 -2788, -2787, -2785, -2784, -2780 的位置。

超长期，3y 成交在 -5960, -5950 的位置。

Spread 上，6s*12s 成交在 -1411 的位置；3s*6s 成交在 -709 的位置；6s*9s 成交在 -715 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2319	-0.39
2W	14	-100	7.2269	-1
1M	24	-217	7.2152	5.2
2M	63	-459	7.1910	-19
3M	91	-667	7.1702	-8
6M	183	-1377	7.0992	-9
9M	275	-2091	7.0278	-47
1Y	365	-2785	6.9584	-66
18M	548	-3905	6.8464	-125
2Y	730	-4750	6.7619	-200
3Y	1095	-5950	6.6419	-250
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0968	
CLOSING SPOT RATE			7.2369	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-241.7	-449.7	-1159.7	-1873.7	-2567.7
2M		-208	-918	-1632	-2326
3M			-710	-1424	-2118
6M				-714	-1408
9M					-694



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