

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

【2024-08-06】

今日 Fixing 定在 7.1318, 较上一交易日上调了 27 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 -10~-7 的位置; T/N 成交在 -10.67~-9.95 的位置; S/N 成交在 -10.3~-9.6 的位置。1s 成交在 -299, -297.5, -296.5, -295 的位置; 2s 成交在 -553, -552 的位置; 3s 成交在 -788, -787 的位置; 4s 成交在 -1020 的位置。

中长时间, 6s 成交在 -1486, -1480, -1475, -1470 的位置; 9s 成交在 -2065, -2063 的位置; 1y 成交在 -2600, -2595, -2593, -2590, -2585, -2579, -2555 的位置, 尾盘收在 -2555 的位置。

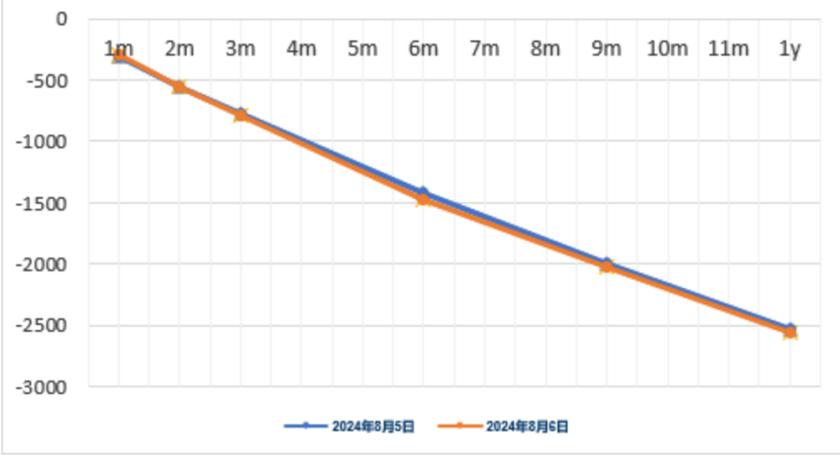
超长期, 2y 成交在 -4200, -4170 的位置; 4y 成交在 -5850 的位置; 5y 成交在 -6300 的位置。

Spread 上, 6s*9s 成交在 -565 的位置; 6s*1y 成交在 -1110 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-67	7.1402	-0.1
2W	14	-135	7.1334	-5
1M	32	-297	7.1173	7.5
2M	61	-547	7.0922	3
3M	92	-789	7.0680	-17
6M	186	-1468	7.0001	-46
9M	273	-2030	6.9439	-30
1Y	365	-2554	6.8915	-20
18M	550	-3440	6.8029	-40
2Y	732	-4159	6.7310	-59
3Y	1096	-5250	6.6219	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1318	
CLOSING SPOT RATE			7.1469	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-250.5	-492.5	-1171.5	-1733.5	-2257.5
2M		-242	-921	-1483	-2007
3M			-679	-1241	-1765
6M				-562	-1086
9M					-524

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