

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-06-26】

今日 Fixing 定在 7.1248, 较上一交易日下调了 23 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所下行。

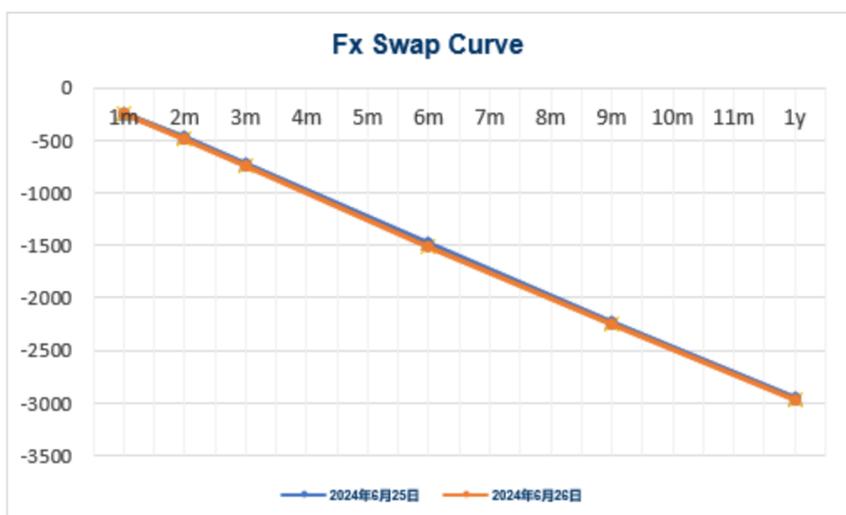
短端, O/N 成交在 -6.9~-6.5 的位置; T/N 成交在 -7.3~-6.66 的位置; S/N 成交在 -22.4~-22.22 的位置。1w 较多成交在 -52.7, -52.1, -52 的位置; 3w 成交在 -159.5 的位置; 1s 成交在 -251 的位置; 2s 成交在 -492 的位置; 3s 成交在 -746, -742 的位置。

中长期, 6s 成交主要成交 -1505, -1503, -1500 的位置; 9s 成交在 -2252, -2250, -2248 的位置; 1y 成交在 -2980, -2975, -2974, -2971 的位置。

Spread 上, 1s*3s 成交在 -493 的位置; 2s*3s 成交在 -254 的位置; 3s*6s 成交在 -761 的位置; 6s*9s 成交在 -747 的位置; 6s*1y 成交在 -1468, -1467 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2614	7.55
2W	14	-106	7.2561	0
1M	33	-251	7.2415	-5.2
2M	63	-491	7.2175	-14
3M	94	-743	7.1924	-13.5
6M	186	-1506	7.1160	-20
9M	276	-2250	7.0416	-16
1Y	367	-2971	6.9695	-12
18M	549	-4110	6.8556	10
2Y	731	-5035	6.7631	-25
3Y	1096	-6085	6.6581	-10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1248	
CLOSING SPOT RATE			7.2666	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-240	-491.8	-1254.9	-1999.3	-2720.3
2M		-251.8	-1014.9	-1759.3	-2480.3
3M			-763.1	-1507.5	-2228.5
6M				-744.4	-1465.4
9M					-721



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