

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-07-22】

今日 Fixing 定在 7.1335，较上一交易日下调了 20 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

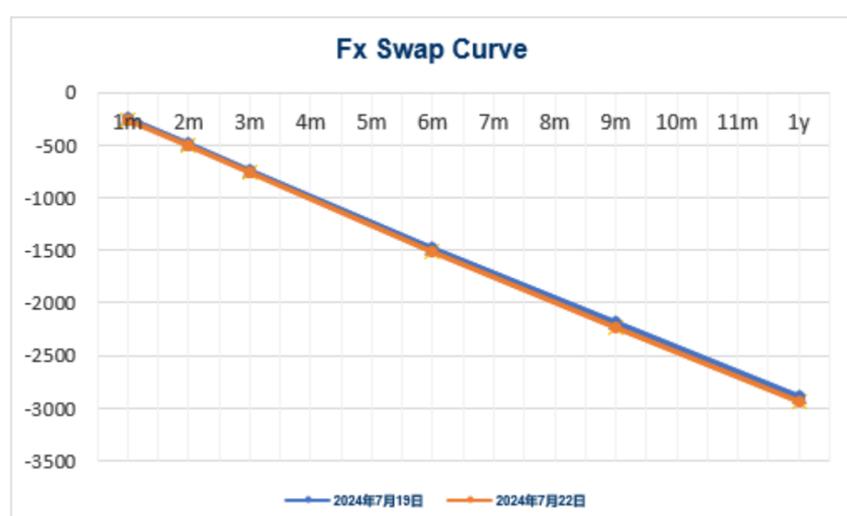
短端，O/N 成交在 -10~-8.55 的位置；T/N 成交在 -8.35~-8.03 的位置；S/N 成交在 -8.21~-8.2 的位置。1w 较多成交在 -57.2，-56 的位置；3w 成交在 -170 的位置；1s 成交在 -269，-268，-267.5，-263 的位置；2s 成交在 -501，-500 的位置；3s 成交在 -751，-749 的位置；4s 成交在 -1012 的位置。

中长期，6s 成交主要成交 -1509，-1508 的位置；9s 成交在 -2228 的位置；1y 今日成交较多，开盘在 -2941 的位置，随后一路走高，较多成交在 -2839，-2938 的位置，尾盘收在 -2940 的位置。

Spread 上，1w*1s 成交在 -210.5 的位置；1s*2s 成交在 -237 的位置；1s*3s 成交在 -482.5 的位置；2s*3s 成交在 -246 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-58	7.2680	-2.43
2W	14	-115	7.2622	-5
1M	33	-269	7.2468	-25.9
2M	62	-506	7.2232	-13
3M	92	-750	7.1987	-14.2
6M	184	-1509	7.1229	-29
9M	274	-2228	7.0509	-38
1Y	365	-2940	6.9797	-49
18M	551	-4110	6.8627	-100
2Y	730	-4990	6.7747	-95
3Y	1097	-6150	6.6587	-190
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1335	
CLOSING SPOT RATE			7.2737	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-236.5	-481	-1239.5	-1959	-2671
2M		-244.5	-1003	-1722.5	-2434.5
3M			-758.5	-1478	-2190
6M				-719.5	-1431.5
9M					-712



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