

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-08-16】

今日 Fixing 定在 7.1464, 较上一交易日上调了 65 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 -23~-22 的位置; T/N 成交在 -7.34~-7.26 的位置; S/N 成交在 -7.49~-7.32 的位置。1w 成交在 -53.5, -53.2 的位置; 1s 成交在 -252.5 的位置; 3s 成交在 -732, -731.5, -731 的位置; 4s 成交在 -956 的位置。

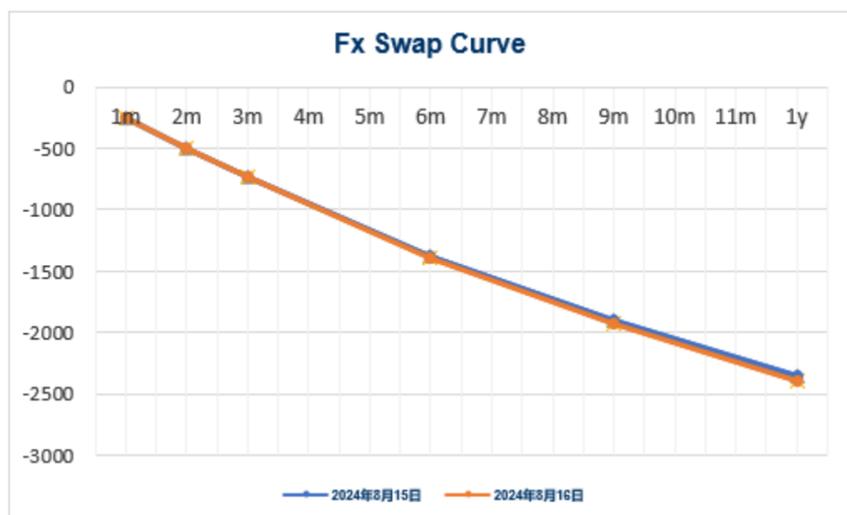
中长期, 6s 成交在 -1394, -1390, -1389, -1388 的位置; 9s 成交在 -1924, -1923, -1918 的位置; 1y 成交在 -2404, -2395, -2384 的位置。

超长期, 18s 成交在 -3130, -3120, -3110 的位置。

Spread 上, 1w*2w 成交在 -58.3 的位置; 9s*1y 成交在 -474 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1627	-0.3
2W	14	-112	7.1568	7
1M	31	-252	7.1428	-0.5
2M	62	-504	7.1176	-4
3M	92	-730	7.0950	-1
6M	184	-1393	7.0287	-13
9M	273	-1926	6.9754	-29
1Y	365	-2400	6.9280	-44
18M	552	-3130	6.8550	-30
2Y	730	-3800	6.7880	0
3Y	1095	-4830	6.6850	-30
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1464	
CLOSING SPOT RATE			7.1680	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-252	-478	-1141	-1674	-2148
2M		-226	-889	-1422	-1896
3M			-663	-1196	-1670
6M				-533	-1007
9M					-474



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