

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-08-20】

今日 Fixing 定在 7.1325, 较上一交易日上调了 90 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 -7.3~-7.2 的位置; T/N 成交在 -7.34~-7.2 的位置; S/N 成交在 -7.4~-7.39 的位置。1w 成交在 -52.8, -52.6, -52.5 的位置; 2w 成交在 -111, -110.5, -109 的位置; 3w 成交在 -165 的位置; 1s 成交在 -252.5, -252, -251.5 的位置; 2s 成交在 -481 的位置; 3s 成交在 -717, -716 的位置。

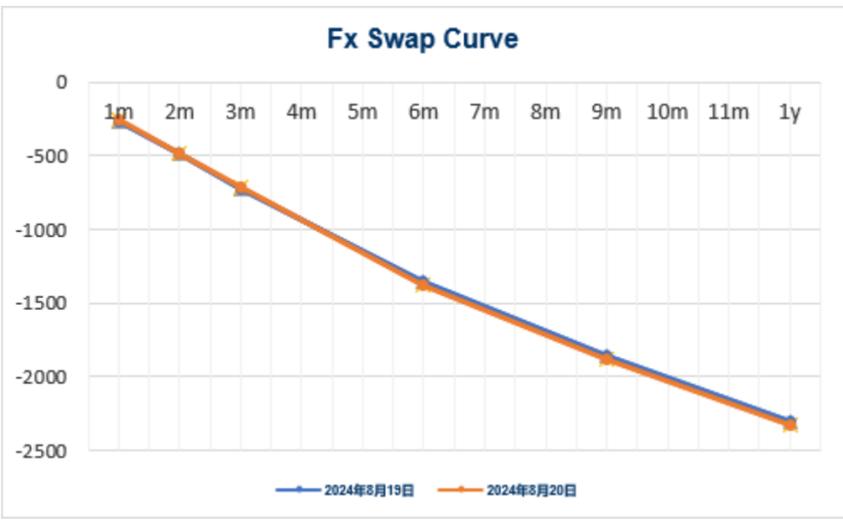
中长期, 6s 成交在 -1366, -1365 的位置; 9s 成交在 -1872 的位置; 1y 成交在 -2319, -2317 的位置。

超长期, 18s 成交在 -3010 的位置。

Spread 上, 1w\*2w 成交在 -58 的位置; 2w\*1s 成交在 -141.5 的位置; 3s\*6s 成交在 -653 的位置; 6s\*1y 成交在 -920 的位置; 9s\*1y 成交在 -445 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1366	0.65
2W	14	-110	7.1309	0
1M	32	-252	7.1167	12
2M	61	-480	7.0939	6
3M	92	-716	7.0703	4.2
6M	186	-1372	7.0047	-17
9M	273	-1877	6.9542	-16
1Y	365	-2326	6.9093	-18
18M	550	-3000	6.8419	0
2Y	732	-3665	6.7754	-15
3Y	1096	-4760	6.6659	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1325	
CLOSING SPOT RATE			7.1419	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-228.3	-464.1	-1120.3	-1625.3	-2074.3
2M		-235.8	-892	-1397	-1846
3M			-656.2	-1161.2	-1610.2
6M				-505	-954
9M					-449



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**