

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

【2024-05-22】

今日 Fixing 定在 7.1077, 较上一交易日上调了 8 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 -7.3~-7.15 的位置, T/N 成交在 -7.05~-6.93 的位置, S/N 成交在 -28.38~-28.2 的位置。1w 今日开盘在 -50.25 位置, 随后一路上涨, 最高在 -49.96 的位置; 1s 今日成交较少, 反复成交在 -227 的位置; 2s 成交在 -455.7 的位置; 3s 成交较少, 主要成交在 -711.5 的位置, 尾盘收在 -713 的位置; 5s 今日有较多成交, 盘中在 -1181 位置成交较多, 尾盘在 -1190 有少许成交。

中长期, 6s 开盘在 -1442.5 的位置, 最后收在 -1452 的位置; 9s 成交在 -2190 的位置, 成交寥寥; 1y 成交较为活跃, 开盘在 -2885 的位置, 盘中一路走低, 尾盘有部分成交在 -2912 的位置。

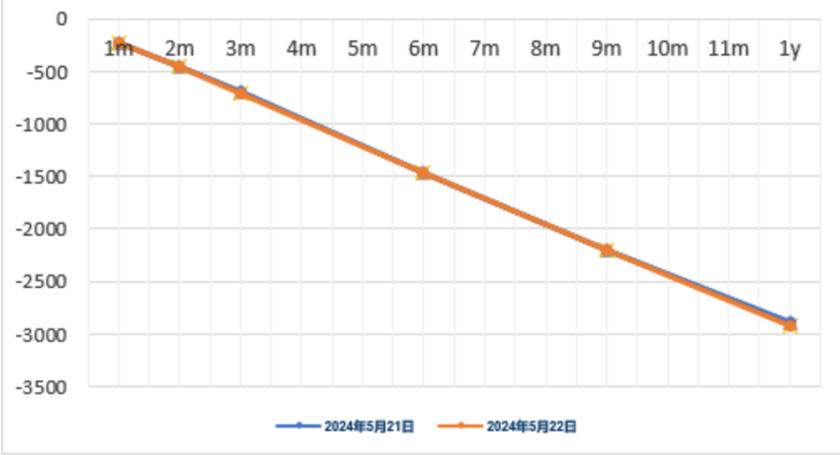
超长期限, 18s 成交在 -4044 的位置; 2y 成交在 -4900 的位置。

Spread 上, 6s*9s 成交在 -737 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2346	0.05
2W	14	-102	7.2294	0
1M	31	-228	7.2168	7.1
2M	62	-456	7.1940	1
3M	92	-713	7.1683	-14.08
6M	184	-1456	7.0941	3
9M	276	-2202	7.0194	-7
1Y	365	-2919	6.9477	-36
18M	549	-4050	6.8346	0
2Y	730	-4910	6.7486	-10
3Y	1095	-5900	6.6496	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1077	
CLOSING SPOT RATE			7.2396	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-228.1	-485.08	-1227.7	-1974.2	-2691.2
2M		-256.98	-999.6	-1746.1	-2463.1
3M			-742.62	-1489.12	-2206.12
6M				-746.5	-1463.5
9M					-717

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