

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-04-26】

今日 Fixing 定在 7.1056，较上一交易日下调了 2 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

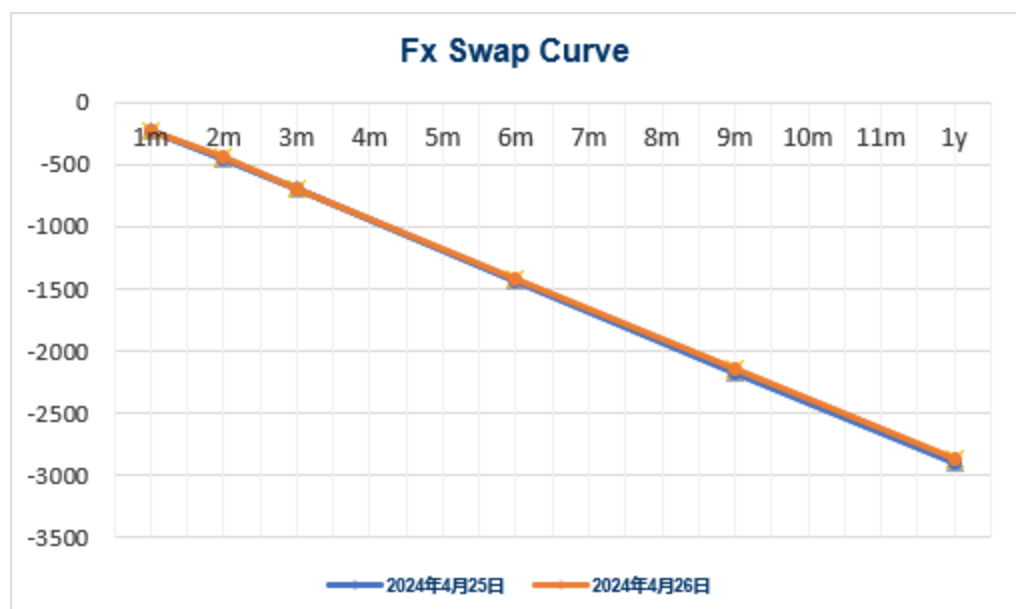
短端，O/N 成交在 -22~-20.5 的位置，T/N 成交在 -7.2~-6.93 的位置，S/N 成交在 -44.5~-43.5 的位置。1w 成交在 -51.8，-50.9 的位置；2w 成交在 -104，-103.5，-102 的位置；1s 成交在 -232，-230 的位置；2s 成交在 -450，-448，-443 的位置；3s 成交在 -699，-695，-693 的位置。

中长期，6s 成交在 -1440，-1430 的位置；9s 成交在 -2170，-2168，-2167 的位置；1y 反复成交在 -2930，-2925，-2920，-2890，-2880 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -52 的位置；2w*1s 成交在 -126.5 的位置；6s*9s 成交在 -730 的位置；9s*12s 成交在 -730 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2411	1.59
2W	14	-104	7.2359	3
1M	30	-230	7.2233	-2.3
2M	60	-443	7.2020	15
3M	91	-695	7.1769	3.5
6M	183	-1427	7.1036	6
9M	273	-2144	7.0319	26
1Y	365	-2870	6.9593	25
18M	548	-4080	6.8383	0
2Y	730	-5000	6.7463	0
3Y	1095	-6200	6.6263	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1056	
CLOSING SPOT RATE			7.2463	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-212.9	-464.2	-1196.5	-1913.7	-2639.7
2M		-251.3	-983.6	-1700.8	-2426.8
3M			-732.3	-1449.5	-2175.5
6M				-717.2	-1443.2
9M					-726



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