

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-05-15】

今日 Fixing 定在 7.1049，较上一交易日上调了 4 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 -9~-7.29 的位置，T/N 成交在 -8~-7.23 的位置，S/N 成交在 -22.2~-21.9 的位置。1w 今日成交在 -51.8~-51.3 的位置，成交寥寥；1s 今日成交较多，反复成交在 -230 的位置，最低成交在 -232 的位置；2s 成交在 -462 的位置；3s 开盘在 -717 的位置，随后价格一路买至 -714 的位置，最后收盘在 -719 的位置。

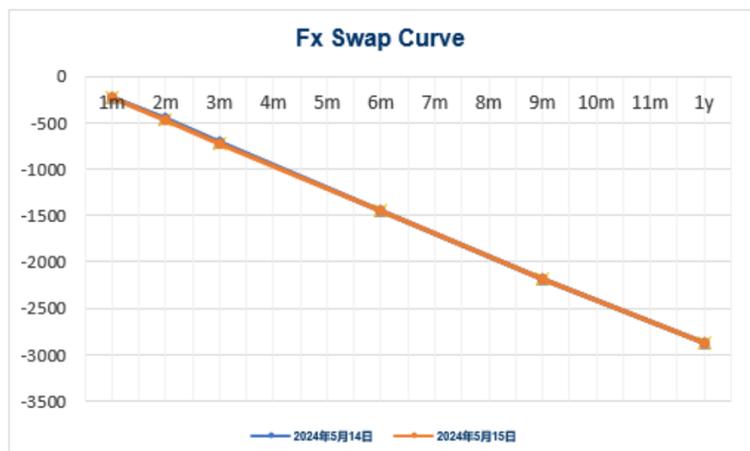
中长期，6s 成交较少，成交价格在 -1440 附近位置；9s 成交在 -2175 的位置，成交寥寥；1y 成交较为活跃，开盘在 -2875 的位置，盘中高点在 -2868 的位置，最后回落至 -2881 处。

超长期，18s 有部分成交，位置在 -4040 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -723，-720 的位置；3s*4s 成交在 -235 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2143	-1.22
2W	14	-104	7.2091	-2
1M	31	-232	7.1963	3.5
2M	62	-462	7.1733	-4
3M	92	-719	7.1476	-15.4
6M	184	-1448	7.0747	-1
9M	276	-2181	7.0014	4
1Y	365	-2880	6.9315	-6
18M	549	-4035	6.8160	15
2Y	730	-4870	6.7325	30
3Y	1095	-6000	6.6195	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1049	
CLOSING SPOT RATE			7.2195	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-230	-486.8	-1216	-1949	-2648
2M		-256.8	-986	-1719	-2418
3M			-729.2	-1462.2	-2161.2
6M				-733	-1432
9M					-699



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