

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

【2024-05-21】

今日 Fixing 定在 7.1069, 较上一交易日上调了 27 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 -7.2~-7 的位置, T/N 成交在 -7.1~-7.03 的位置, S/N 成交在 -7.11~-7.09 的位置。1w 今日开盘在 -50.1 位置, 最低成交在 -50.15 的位置; 2w 今日成交较少, 在 -102 的位置; 1s 今日成交较少, 反复成交在 -235.5 的位置; 2s 成交在 -457, -456 的位置; 3s 成交较少, 主要成交在 -700 的位置, 尾盘收在 -699 的位置。

中长期限, 6s 开盘在 -1465.5 的位置, 反复成交在 -1460 的位置, 最后收在 -1457 的位置; 9s 成交在 -2196 的位置, 成交寥寥; 1y 成交较少, 成交在 -2887 的位置。

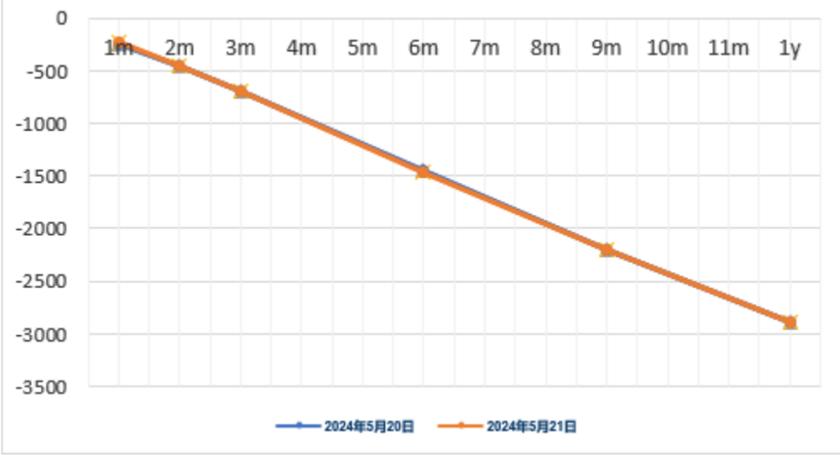
超长期限, 18s 成交在 -4055 的位置。

Spread 上, 1w*2w 成交在 -51.95 的位置; 3s*6s 成交在 -760 的位置; 2s*3s 成交在 -243 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2320	0.47
2W	14	-102	7.2268	0
1M	31	-235	7.2135	8.6
2M	62	-457	7.1913	1
3M	92	-699	7.1671	2.4
6M	184	-1458	7.0912	-12
9M	276	-2195	7.0175	12
1Y	365	-2883	6.9487	1
18M	549	-4050	6.8320	-45
2Y	730	-4900	6.7470	-30
3Y	1095	-5900	6.6470	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1069	
CLOSING SPOT RATE			7.2370	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-222.1	-463.9	-1223.1	-1960.1	-2648.1
2M		-241.8	-1001	-1738	-2426
3M			-759.2	-1496.2	-2184.2
6M				-737	-1425
9M					-688

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