

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

【2024-07-17】

今日 Fixing 定在 7.1318, 较上一交易日下调了 10 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 -7.7~-7.48 的位置; T/N 成交在 -7.77~-7.51 的位置; S/N 成交在 -23.4~-22.9 的位置。1w 较多成交在 -53.8, -53.7, -53.5 的位置; 2w 成交在 -107.5 的位置; 3w 成交在 -162.8, -162.3 的位置; 1s 成交在 -241 的位置; 2s 成交在 -489 的位置; 3s 成交在 -749, -748, -747.5 的位置; 4s 成交在 -981.5 的位置。

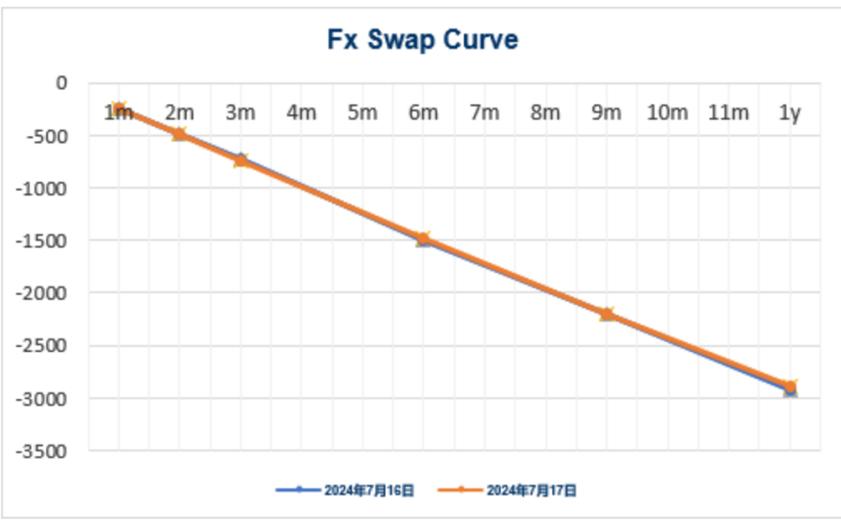
中长期, 6s 成交主要成交 -1497, -1495, -1494 的位置; 9s 成交在 -2222, -2217, -2216 的位置; 1y 今日成交较多, 开盘在 -2931 的位置, 随后一路走高, 较多成交在 -2931, -2928 的位置, 尾盘收在 -2885 的位置。

超长期, 2y 成交在 -4929 的位置。

Spread 上, 1w*2w 成交在 -54 的位置; 2s*3s 成交在 -259 的位置; 3s*6s 成交在 -748.5 的位置; 6s*9s 成交在 -725 的位置; 9s*1y 成交在 -708, -707 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-54	7.2597	-0.02
2W	14	-107	7.2544	0
1M	31	-241	7.2410	7.8
2M	62	-489	7.2162	0
3M	94	-745	7.1906	-15
6M	186	-1487	7.1164	16
9M	276	-2200	7.0451	8
1Y	367	-2896	6.9756	20
18M	550	-4050	6.8601	20
2Y	731	-4900	6.7751	21
3Y	1095	-6000	6.6651	-3
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1318	
CLOSING SPOT RATE			7.2651	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-247.9	-504.2	-1246	-1959	-2654.5
2M		-256.3	-998.1	-1711.1	-2406.6
3M			-741.8	-1454.8	-2150.3
6M				-713	-1408.5
9M					-695.5



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