

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

【2024-05-31】

今日 Fixing 定在 7.1088，较上一交易日上调了 23 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 -33~-26 的位置；T/N 成交在 -7.35~-7.15 的位置，S/N 成交在 -7.4~-7.25 的位置。1w 成交在 -51.5，-51.3 的位置；3w 成交在 -154 的位置；1s 成交较少，在 -229.8，-228.5 的位置；3s 开盘在 -702.5 的位置，成交较少。

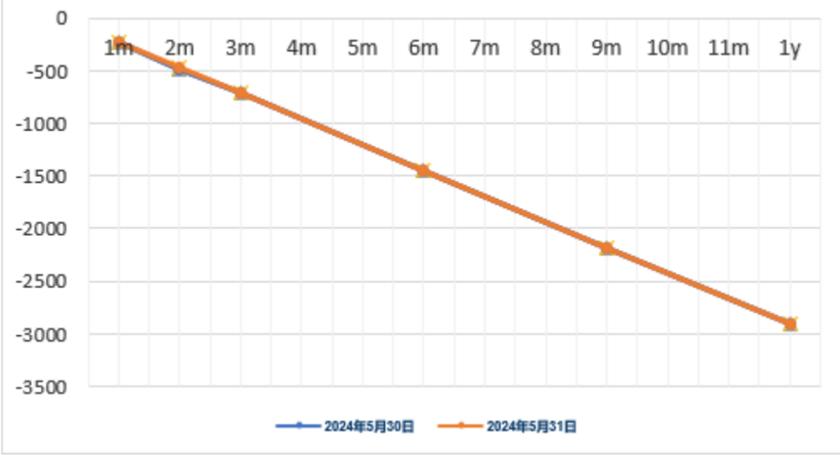
中长期限，6s 成交较多，开盘在 -1439 的位置，随后下跌，午盘后回升，主要成交在 -1440，-1436 的位置；9s 成交在 -2175，-2174，-2168 的位置；1y 成交较为活跃，开盘在 -2893 的位置，大量成交在 -2900，-2893 的位置。

Spread 上，6s*9s 成交在 -732 的位置；3w*1s 成交在 -74.5 的位置；9s*1y 成交在 -1454，-1453 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.2389	9.7
2W	14	-102	7.2338	3
1M	31	-228	7.2212	-3.3
2M	62	-467	7.1973	12
3M	92	-702	7.1738	5
6M	183	-1440	7.1000	5
9M	273	-2180	7.0260	1
1Y	365	-2907	6.9533	1
18M	548	-4060	6.8380	40
2Y	730	-4970	6.7470	10
3Y	1095	-6150	6.6290	-25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1088	
CLOSING SPOT RATE			7.2440	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-239	-473.8	-1211.8	-1951.8	-2678.8
2M		-234.8	-972.8	-1712.8	-2439.8
3M			-738	-1478	-2205
6M				-740	-1467
9M					-727

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