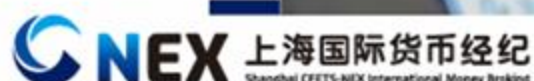


收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-05-06】

今日 Fixing 定在 7.0994，较上一交易日上调了 69 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

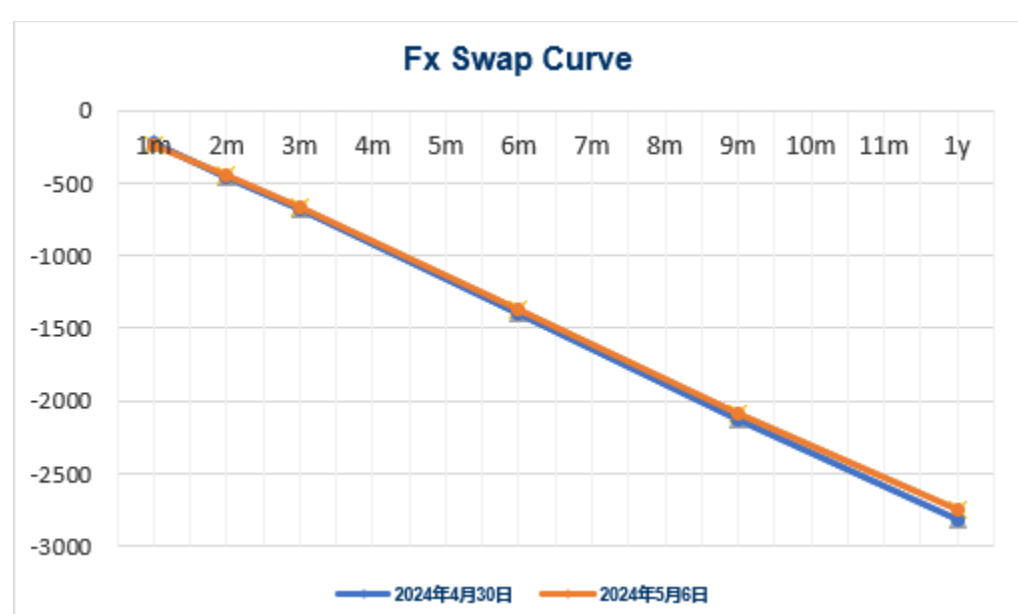
短端，O/N 成交在 -7.2~-6.1 的位置，T/N 成交在 -7.4~-6.85 的位置，S/N 成交在 -7.3~-7.1 的位置。1w 成交在 -50.5，-50 的位置；1s 成交在 -245，-244 的位置；2s 成交在 -445，-444，-443 的位置；3s 成交在 -673，-672，-671 的位置。

中长期，6s 成交在 -1376，-1375 的位置；9s 成交在 -2090，-2080，-2075 的位置；1y 反复成交在 -2752，-2751，-2750 的位置。

Spread 上，3s*6s 成交在 -703，-702 的位置；9s*1y 成交在 -660 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2087	1.3
2W	14	-100	7.2037	4
1M	34	-244	7.1893	-17.5
2M	61	-444	7.1693	13
3M	92	-672	7.1465	9
6M	184	-1374	7.0764	23
9M	278	-2092	7.0045	38
1Y	365	-2753	6.9384	67
18M	551	-3875	6.8262	125
2Y	730	-4700	6.7437	190
3Y	1097	-5900	6.6237	250
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0994	
CLOSING SPOT RATE			7.2137	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-200	-428	-1129.5	-1848	-2509
2M		-228	-929.5	-1648	-2309
3M			-701.5	-1420	-2081
6M				-718.5	-1379.5
9M					-661



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