

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

【2024-08-05】

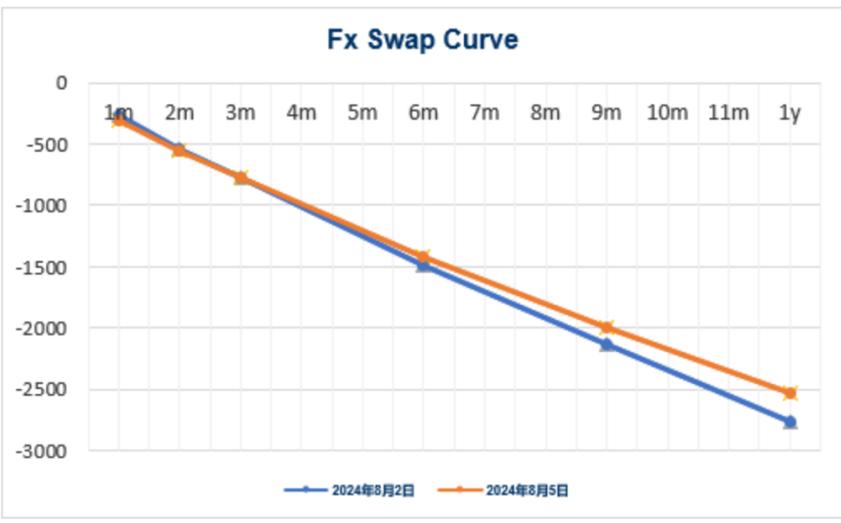
今日 Fixing 定在 7.1345，较上一交易日上调了 31 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

短端，O/N 成交在 -10.3~-8.9 的位置；T/N 成交在 -10.8~-9 的位置；S/N 成交在 -10~-9.5 的位置。1w 成交在 -68, -67.5, -65 的位置；2w 成交在 -133, -130 的位置；1s 成交在 -305, -304, -302 的位置；2s 成交在 -544, -537, -530 的位置；3s 成交在 -755 的位置。

中长期，6s 成交在 -1435, -1417, -1414 的位置；9s 成交在 -2020, -2015, -2010, -2000 的位置；1y 成交在 -2575, -2557, -2540, -2532, -2530 的位置，尾盘收在 -2535 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-67	7.1318	-6
2W	14	-130	7.1255	-10
1M	33	-304	7.1081	-37.9
2M	62	-550	7.0835	-15
3M	92	-772	7.0613	0
6M	184	-1422	6.9963	69
9M	273	-2000	6.9385	132
1Y	365	-2534	6.8851	230
18M	551	-3400	6.7985	350
2Y	730	-4100	6.7285	400
3Y	1097	-5250	6.6135	350
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1345	
CLOSING SPOT RATE			7.1385	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-246	-468	-1118	-1696	-2230
2M		-222	-872	-1450	-1984
3M			-650	-1228	-1762
6M				-578	-1112
9M					-534



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