

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-09-23】

今日美元/人民币中间价报 7.0531，较上一个交易日下调 113bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 成交在-7~-6.2 之间；TN 从-6.25 一路给到-6.95，尾盘收在-6.89 附近；SN 从-6.45 给到-6.87，尾盘收在-6.83 附近。

1W 成交在-86.3~-86 之间，2W 成交在-92.5，3W 成交在-138~-137 之间。1S 成交在-195.5~-195 之间；2S 成交在-387~-385 附近；3S 成交在-565~-558.8 附近；4S 成交在-729。

中长期，6S 成交在-1025~-1022 之间，尾盘给到-1033 附近；9S 成交在-1472 附近；1Y 成交在-1865~-1860 之间，尾盘收在-1868 附近。

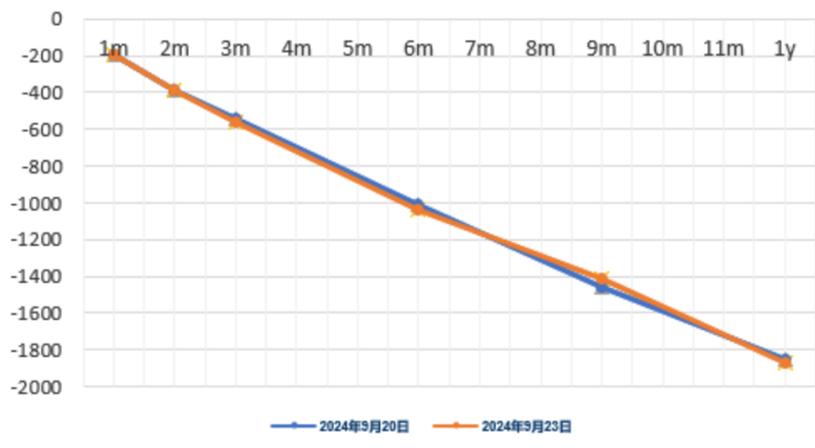
超长期，18S 成交在-2400，3Y 成交在-3600。

Spread 方面，3W*1S 成交在-57、-57.6、-58，5*6S 成交在-151。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	13	-86	7.0501	2.64
2W	14	-93	7.0494	-4
1M	30	-196	7.0391	-3.1
2M	61	-386	7.0202	-1
3M	92	-563	7.0024	-16.5
6M	181	-1039	6.9548	-28
9M	273	-1416	6.9171	46
1Y	365	-1868	6.8719	-13
18M	546	-2400	6.8187	-50
2Y	733	-2800	6.7787	-75
3Y	1097	-3580	6.7007	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0531	
CLOSING SPOT RATE			7.0587	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-189.2	-366.7	-842.7	-1219.7	-1671.7
2M		-177.5	-653.5	-1030.5	-1482.5
3M			-476	-853	-1305
6M				-377	-829
9M					-452

Fx Swap Curve



文 / Ray Yan

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