

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-10-21】

今日美元/人民币中间价报 7.0982，较上一个交易日下调 292bp，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

ON 成交在-6.45~-5.8；TN 成交在-6.25~-5.8；SN 成交在 -6.2~-5.81 之间。

1w 成交在 -43.5, -43, -42, -41.5 的位置；2W 成交在-84 的位置。1S 反复成交在 -191~-189 之间；2S 从 -344 买到 -343；3S 成交在 -515,-514, -513, -510,-509,-506 附近。

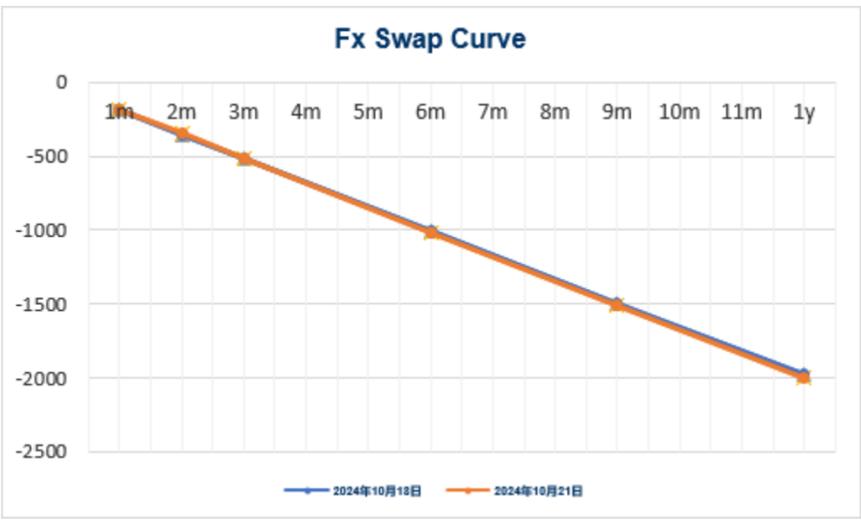
中长期，6s 成交在-1010, -1008, -1005, -998 午后给到过 -1017，尾盘收在-1015；9S 成交在-1500, -1498, -1495, -1493, -1490, -1487, -1485，午后给到-1505 附近，尾盘收在-1513；1Y 从-1945.5, -1950, -1952, -1955 给到 -1960，午后又给到 -1965, -1970, -1971, -1975, -1980, -1985, -1990 附近，尾盘收在 -1995。

超长期限，2y 成交在-3200。

Spread 方面，1s*2s 成交在-155,2s*3s 成交在-165, 3s*6s 成交在-503, -500, 3s*9s 成交在-996, -994, 6s*9s 成交在-493, -490；6s*1y 成交在-976,-965；9s*1y 成交在-480。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	7.1077	0.82
2W	14	-83	7.1035	1
1M	33	-189	7.0929	-6.8
2M	61	-345	7.0773	13
3M	92	-514	7.0604	5
6M	182	-1019	7.0099	-17
9M	273	-1513	6.9605	-17
1Y	365	-1995	6.9123	-22
18M	547	-2700	6.8418	-70
2Y	730	-3200	6.7918	-150
3Y	1097	-3885	6.7233	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0982	
CLOSING SPOT RATE			7.1118	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-155.7	-325.1	-830.1	-1324.1	-1806.1
2M		-169.4	-674.4	-1168.4	-1650.4
3M			-505	-999	-1481
6M				-494	-976
9M					-482



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