

收盘日评

银行间外汇衍生品市场

常规报告系列



【2024-11-11】

今日美元/人民币中间价报 7.1786，较上一个交易日上调 353bp，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

TN 成交在-5.6~-5.45；SN 成交在 -5.6~-5.4 之间。

1w 成交在-39.5， -39， -38.5 的位置； 1S 反复成交在 -163.5~-162 之间； 2S 从 -333 买到 -331， 午后又给到-333.5； 3S 成交在 -513.5， -513， -512.5，-512，-510 附近。

中长期限， 6s 成交在-1065,-1062,-1060,-1058,-1050 午后给到过 -1056， 尾盘收在-1063； 9S 成交在-1631,-1629,-1625,-1620,-1610 附近； 1Y 从-2170 买到 -2160 附近， 午后又给到 -2165,-2175,-2180,-2195 附近， 尾盘收在 -2200。

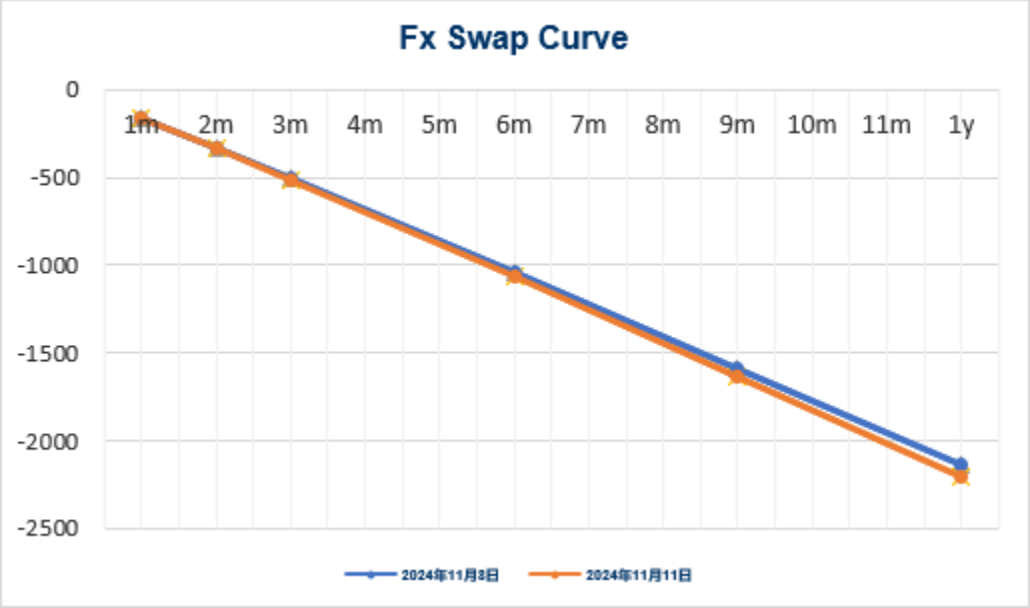
超长期限， 2y 成交在-3730， -3720。

Spread 方面， 2s*3s 成交在-178.5； 3s*6s 成交在-553.5， -549。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-38	7.1861	0.76
2W	14	-76	7.1823	2
1M	30	-164	7.1736	-1.5
2M	61	-334	7.1566	2
3M	92	-514	7.1386	-5.6
6M	181	-1063	7.0836	-25
9M	273	-1631	7.0268	-45
1Y	365	-2203	6.9696	-63
18M	546	-3050	6.8849	-50
2Y	730	-3730	6.8169	-80
3Y	1097	-4815	6.7084	-165
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1786	
CLOSING SPOT RATE			7.1899	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y

1M	-170	-350	-899.5	-1467.5	-2039.5
2M		-180	-729.5	-1297.5	-1869.5
3M			-549.5	-1117.5	-1689.5
6M				-568	-1140
9M					-572



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