常规报告系列

收盘日评
银行间外汇远掉市场

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-10-14】

今日美元/人民币中间价报 7.0723，较上一个交易日下调 8bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

TN 成交在-5.9~-5. 55； SN 成交在 -5.79~-5.6 之间。

1w 成交在 -40.5,-40 的位置，午后买到 -39.9； 2W 成交在-82~-80.5 之间。1S 反复成交在 -193~-186.5 之间 ； 2S 从 -346 买到 -343； 3S 成交在 -515,-510,-509,-506,-505 附近。

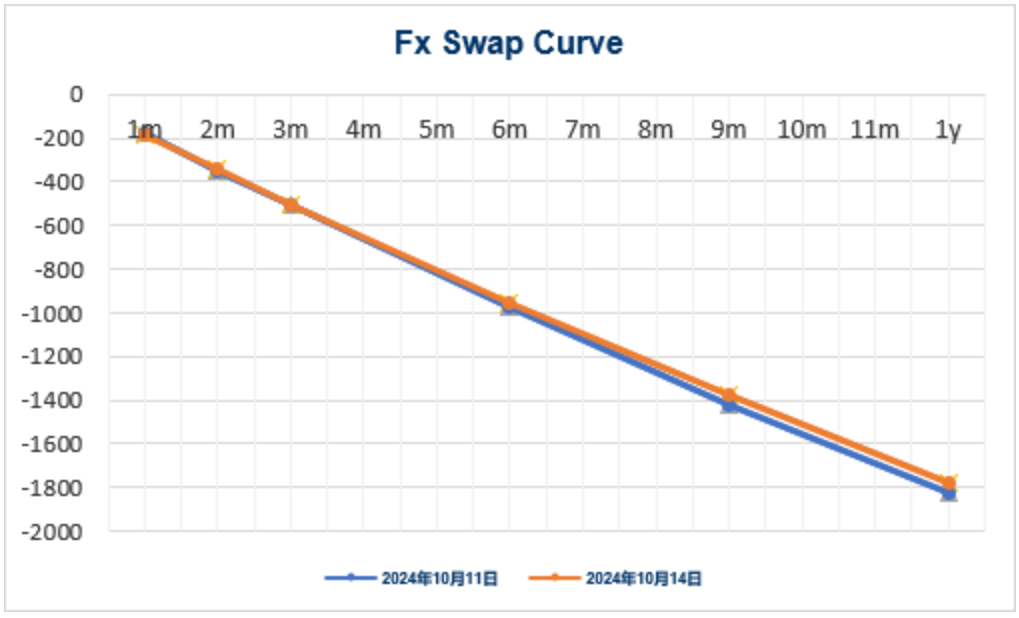
中长期限， 6s 成交在-980，-975，-970，-965，午后买到过 -956 ，尾盘收在-952 ； 9S 成交在-1443，-1427，-1425，-1420,-1404 ，午后买到-1401 附近，尾盘收在-1381；1Y 从-1850，-1845，-1840，-1835，-1820 , 买到 -1810 ，午后又买到 -1803，-1790，-1785，-1783，-1780 附近，尾盘收在 -1779 。

超长期限， 3y 成交在-3500 的位置。

Spread 方面，9s*1y 成交在-398。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.0755	0.1
2W	14	-80	7.0715	1
1M	33	-188	7.0607	-9
2M	61	-342	7.0453	9
3M	92	-502	7.0293	8
6M	182	-952	6.9843	22
9M	273	-1381	6.9414	40
1Y	365	-1779	6.9016	42
18M	547	-2325	6.8470	100
2Y	730	-2700	6.8095	65
3Y	1097	-3505	6.7290	45
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0723	
CLOSING SPOT RATE			7.0795	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-154	-314	-764	-1193	-1591
2M		-160	-610	-1039	-1437
3M			-450	-879	-1277
6M				-429	-827
9M					-398



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。