

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

【2024-10-15】

今日美元/人民币中间价报 7.0830，较上一个交易日上调 107 bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-6.55~-6； T/N 成交在-5.84~-5.73； S/N 成交在-5.85~-5.78； 2w 成交在-82； 1s 成交在-184， -183.5， -182； 2s 成交在-348； 3s 成交在-512~-499。

中长期， 6s 成交在-970， -952； 9s 开始成交在-1360， -1365， 后面给到-1370， -1373， -1400， -1402； 1y 成交在-1758， -1761， -1785， -1782， 后面又给到-1805， 最后收在-1810 附近。

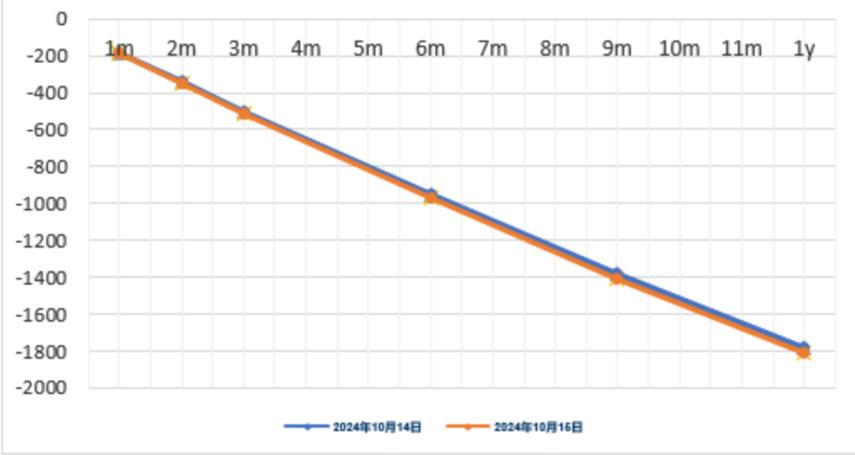
超长期限， 2y 成交在-2830， -2700； 3y 成在-3630， -3600； 4y 成在 -4100。

Spread 方面， 2s*3s 成交在-162； 3s*6s 成交在-458； 6s*9s 成交在-432。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	7.1106	-1.2
2W	14	-83	7.1065	-3
1M	33	-185	7.0962	3.3
2M	61	-350	7.0797	-8
3M	92	-511	7.0636	-9
6M	182	-973	7.0174	-21
9M	273	-1410	6.9737	-29
1Y	365	-1808	6.9339	-29
18M	547	-2325	6.8822	0
2Y	730	-2820	6.8327	-120
3Y	1097	-3725	6.7422	-220
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0830	
CLOSING SPOT RATE			7.1147	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-165.3	-326.3	-788.3	-1225.3	-1623.3
2M		-161	-623	-1060	-1458
3M			-462	-899	-1297
6M				-437	-835
9M					-398

Fx Swap Curve



文 / Edison Zeng

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