

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

【2024-09-27】

今日美元/人民币中间价报 7.0101，较上一个交易日下调 253bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 成交在 -17.5~-14 之间；TN 早盘在 -38.5~-37 之间反复成交，午后从 -39 买到 -28，尾盘收在 -24；SN 成交在 -6.3~-5.5 之间，尾盘收在 -6.3。

1w 成交在 -43~-40 之间；2W 成交在 -85~-82 之间；3w 成交在 -125~-123。1S 反复成交在 -180~-185 之间，午后给到 189；2S 从 -362.5 给到 -369.05；3S 成交在 -530, -528, -527, -525, -524, -523 附近；4S 从 -688 给到 -690，午后从 -690 给到 -693。

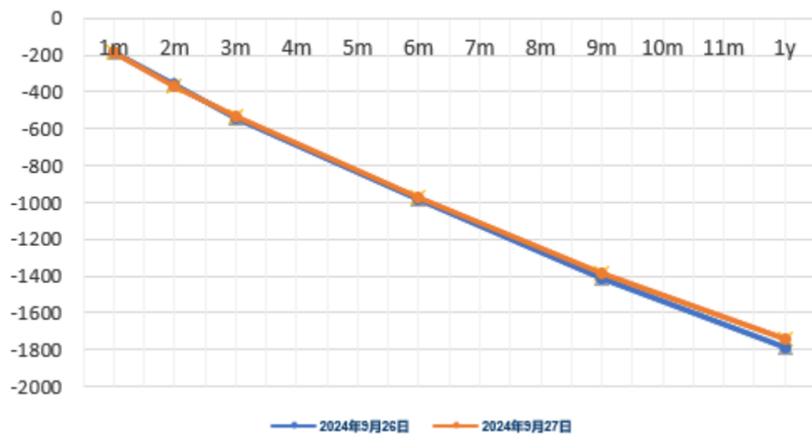
中长期，6S 从 -968, -970, -972, -973 给到过 -975；9S 成交在 -1390, -1388, -1385, -1383, -1380 附近；1Y 从 -1730 买到 -1720，后又给回 -1745，尾盘收在 -1745。

Spread 方面，2w*3w 成交在 -40.1；2s*3s 成交在 -166.5；6s*1y 成交在 -760~-756 之间。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-45	7.0115	0.3
2W	14	-87	7.0073	2
1M	31	-190	6.9970	-1.7
2M	62	-369	6.9791	-7
3M	92	-534	6.9626	6
6M	182	-973	6.9187	11
9M	273	-1390	6.8770	23
1Y	366	-1745	6.8415	46
18M	547	-2300	6.7860	0
2Y	730	-2550	6.7610	150
3Y	1095	-3350	6.6810	28
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0101	
CLOSING SPOT RATE			7.0160	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-179	-344	-783	-1200	-1555
2M		-165	-604	-1021	-1376
3M			-439	-856	-1211
6M				-417	-772
9M					-355

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