



【2024-10-28】

今日美元/人民币中间价报 7.1307，较上一个交易日上调 217bp，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

ON 成交在-6.25~-6.1；TN 成交在-6.02~-5. 8 ；SN 成交在 -6~-5.91 之间。

1w 成交在 -41,-40.91,-40.9,-40.87,-40.8 的位置；2W 成交在-82.5 的位置。1S 反复成交在 -175~-174 之间 ；2S 从 -361 买到 -359 ；3S 成交在 -536.8,-535.8,-535,-534,-533.5,-533 附近。

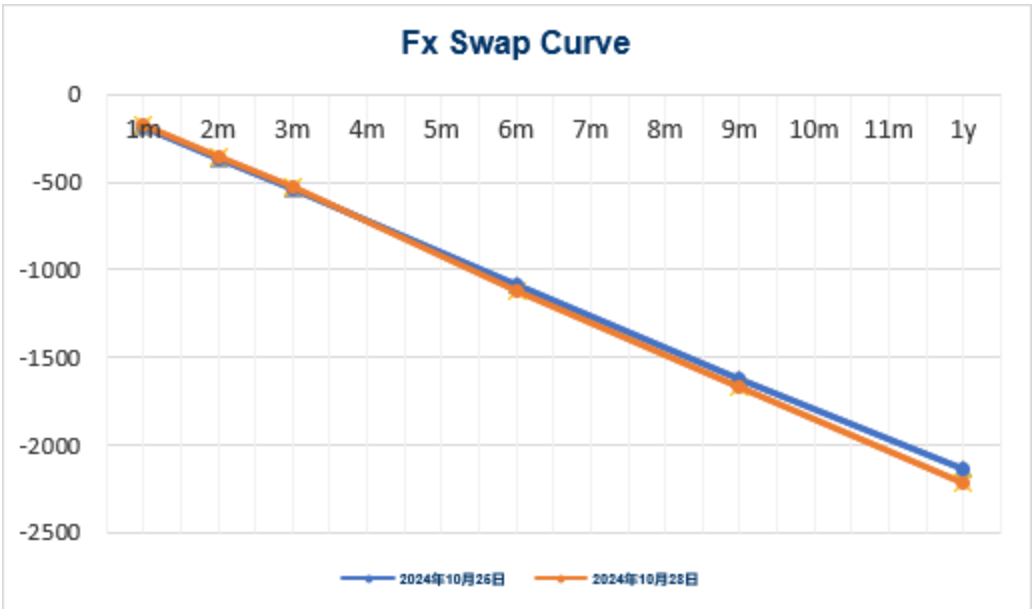
中长期限，6s 成交在-1123,-1121,-1120,-1118，-1115 午后买到过 -1112 ，尾盘收在-1115.5 ；9S 成交在-1675，-1670，-1668 附近；1Y 从-2225，-2220，-2219，-2215 买到 -2210 ，午后又给到 -2220，-2222，-2223 附近，尾盘收在 -2215 。

超长期限，18s 成交在-3050。

Spread 方面，2s*3s 成交在-174，-173；3s*6s 成交在-586，-585。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	7.1232	-0.65
2W	14	-83	7.1191	-1
1M	30	-175	7.1098	5.9
2M	61	-359	7.0914	7
3M	89	-533	7.0741	1.5
6M	182	-1117	7.0157	-27
9M	273	-1667	6.9606	-49
1Y	365	-2222	6.9051	-82
18M	547	-3020	6.8253	-120
2Y	730	-3700	6.7573	-230
3Y	1094	-4600	6.6673	-200
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1307	
CLOSING SPOT RATE			7.1273	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-184.5	-357.8	-941.8	-1492.3	-2047.3
2M		-173.3	-757.3	-1307.8	-1862.8
3M			-584	-1134.5	-1689.5
6M				-550.5	-1105.5
9M					-555



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