

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

【2024-11-04】

今日美元/人民币中间价报 7.1203，较上一个交易日上调 68bp，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

ON 成交在-5.8~-5.6；TN 成交在-5.8~-5.45；SN 成交在 -5.8~-5.7 之间。

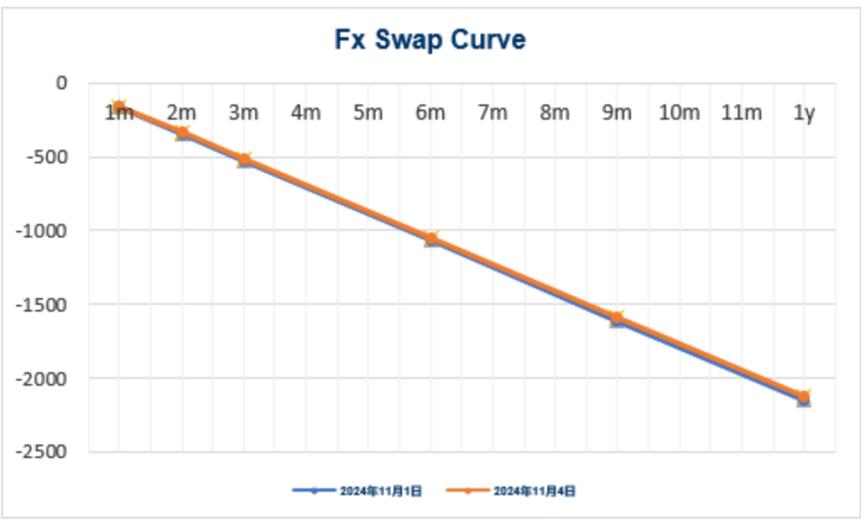
1w 成交在-40.4， -40.3， -40.2， -40.1， -40 的位置；2W 成交在-80.5 的位置；3w 成交在-117.5 的位置。1S 反复成交在 -166.2~-165.5 之间；2S 从 -333 给到 -337；3S 成交在 -519.5， -519， -518， -516， -515 附近。

中长期限，6s 成交在-1030， -1033， -1035， -1038 午后给到过 -1056， 尾盘收在-1054.5；9S 成交在-1595， -1590， -1585， -1580 附近；1Y 从-2085， -2083， -2080， -2075 买到 -2063 附近， 午后又给到 -2090， -2098， -2110， -2122， -2125 附近， 尾盘收在 -2120。

Spread 方面，1s*2s 成交在-171；2s*3s 成交在-182.5， -182， -181；3s*4s 成交在-166， -165；5s*6s 成交在-175；6s*1y 成交在-1038。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.0934	0.09
2W	14	-81	7.0894	-1
1M	30	-166	7.0808	-0.65
2M	61	-338	7.0637	7
3M	92	-519	7.0455	3.6
6M	181	-1055	6.9920	14
9M	273	-1592	6.9383	15.5
1Y	365	-2120	6.8854	31
18M	546	-2930	6.8044	60
2Y	730	-3625	6.7349	25
3Y	1097	-4660	6.6314	-35
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1203	
CLOSING SPOT RATE			7.0974	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-171.15	-352.85	-888.15	-1425.15	-1953.65
2M		-181.7	-717	-1254	-1782.5
3M			-535.3	-1072.3	-1600.8
6M				-537	-1065.5
9M					-528.5



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