



【2024-07-10】

今日美元/人民币中间价报 7.1342，较上一个交易日上调 32bp，各期限收盘价较上一交易日略微下行。

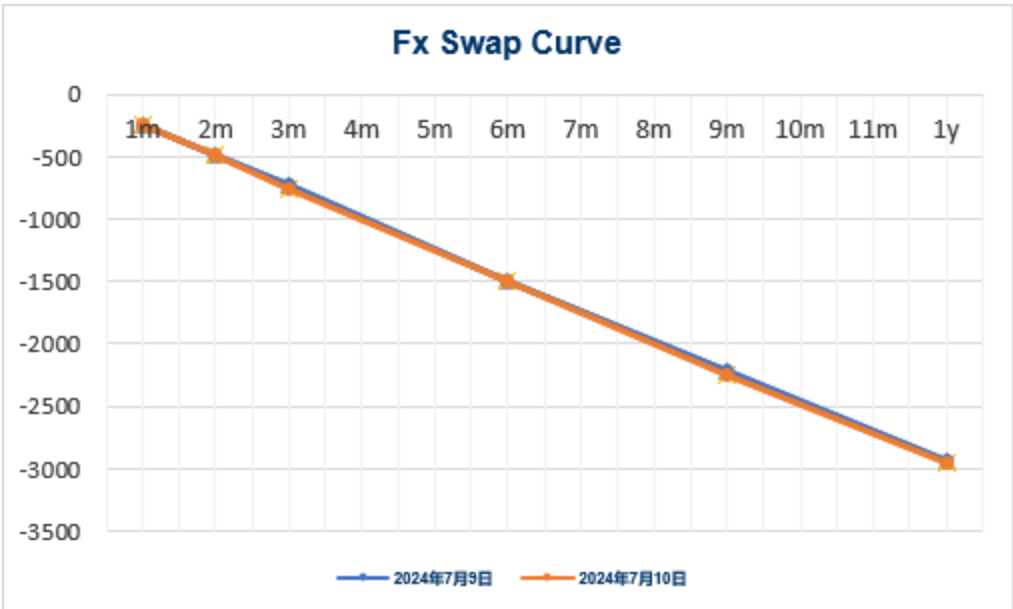
ON 成交在-7.4~-7.25 之间；TN 早盘在-7.35~-7.33 之间来回成交，后一路给到-7.43，尾盘买回到-7.36；SN 从-22.16 给到过-22.2、-22.22、-22.6，尾盘收在-22.58。1W 早上从-51.9 给到-52.1，午后从-52.15 一路给到-52.9；2W 成交在-105.5~-105 之间。1S 从-236.5 给到-237.1；2S 成交在-483 附近；3S 成交在-751~-750.5 之间。

中长期限，6S 成交在-1491、-1490；9S 从-2240 给到-2243；1Y 早上成交在-2955~-2954，午后从-2956 给到-2959。

Spread 方面，1W*2W 成交在-52.5，2*3S 成交在-267.5，5*6S 成交在-265。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2706	-1.38
2W	14	-106	7.2653	-2
1M	31	-237	7.2522	6.2
2M	62	-483	7.2276	-1
3M	95	-751	7.2008	-26.5
6M	185	-1492	7.1267	3
9M	276	-2243	7.0516	-21
1Y	367	-2958	6.9801	-21
18M	549	-4135	6.8624	5
2Y	731	-4995	6.7764	15
3Y	1095	-6050	6.6709	-60
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1342	
CLOSING SPOT RATE			7.2759	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-245.7	-513.7	-1254.7	-2005.7	-2720.7
2M		-268	-1009	-1760	-2475
3M			-741	-1492	-2207
6M				-751	-1466
9M					-715



文 / Cathy He

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