



【2024-10-11】

今日美元/人民币中间价报 7.0731，较上一个交易日下调 11bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 早盘从-21 给到-21.8，午后给到-25；今日无 TN；SN 在-5.7~-5.6 之间反复成交。

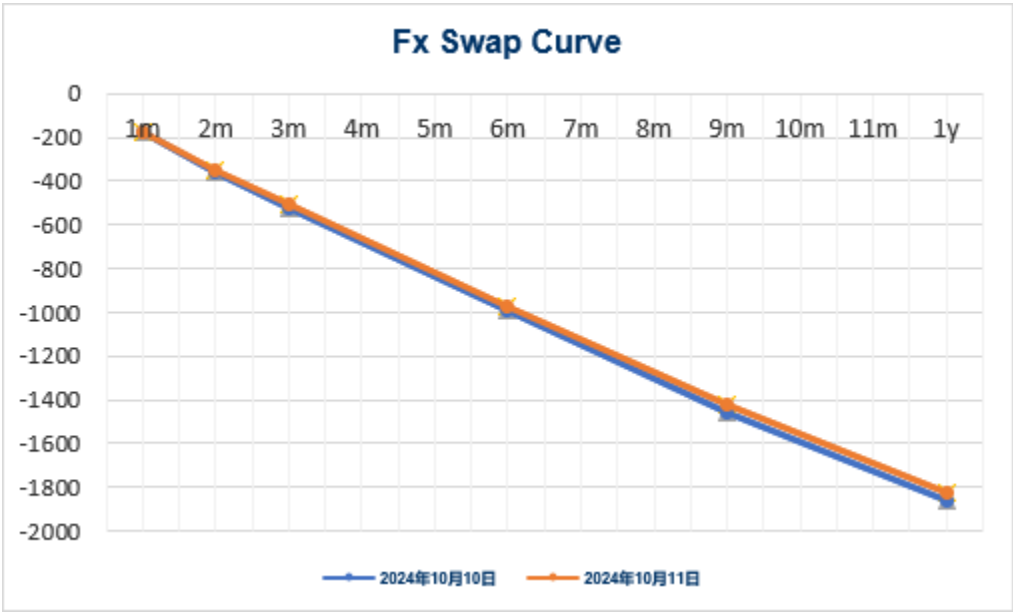
1W 从-40.6 买到-40.38，午后买到-40.2；2W 成交在-80.5 附近。1S 成交在-179、-179.5、-180；3S 成交在-513 附近。

中长期限，6S 早盘成交在-978~-977，午后在-979~-975 之间来回成交，尾盘收在-975；9S 早盘从-1437 买到-1432、-1431，午后买到-1424、-1423；1Y 从-1816 给到-1825、-1823。

Spread 方面，2W*1S 成交在-98.5，1*3S 成交在-333，6*9S 成交在-455，3*12S 成交在-1312。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.0636	-0.1
2W	14	-81	7.0595	1
1M	31	-179	7.0497	2
2M	62	-351	7.0325	7
3M	92	-510	7.0166	11
6M	182	-974	6.9702	21
9M	273	-1421	6.9255	39
1Y	365	-1821	6.8855	44
18M	547	-2425	6.8251	32
2Y	730	-2765	6.7911	85
3Y	1095	-3550	6.7126	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0731	
CLOSING SPOT RATE			7.0676	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-172	-331	-795	-1242	-1642
2M		-159	-623	-1070	-1470
3M			-464	-911	-1311
6M				-447	-847
9M					-400



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