



【2024-09-11】

今日美元/人民币中间价报 7.1182，较上一个交易日上调 46bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 成交在-7.3~-7 之间；TN 成交在-7.55~-7.2 之间；SN 成交在-38~-37 之间。

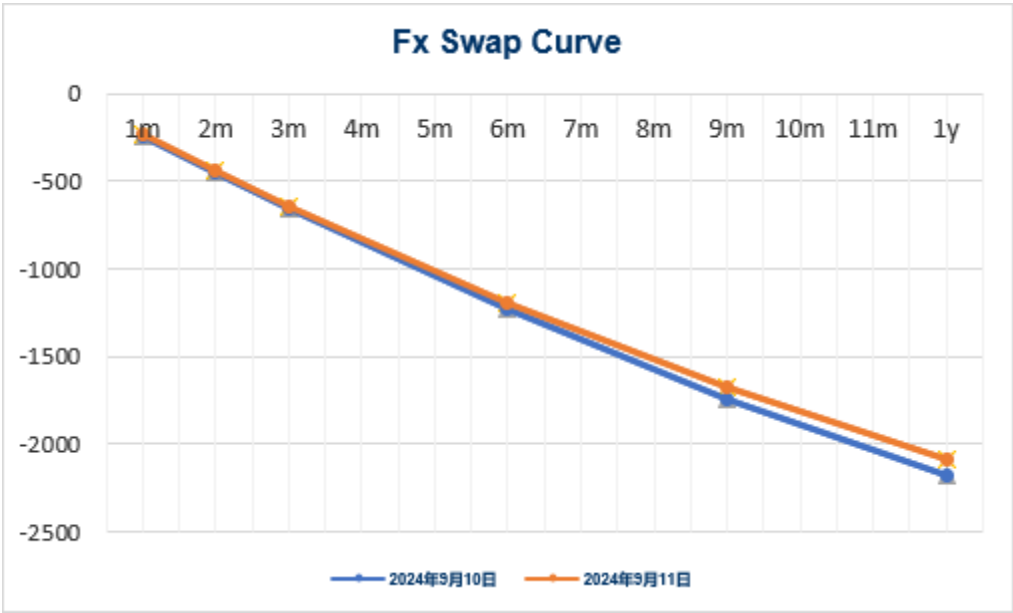
1W 成交在-53.5， -53.45， -53； 2W 成交在-105.5， -104.5； 1S 成交在-238， -237.5； 2S 成交在-443； 3S 成交在-646~-641 之间； 4s 成交在-850~-842； 5S 成交在-1037， 1030。

中长期限， 6S 从-1210 买到-1193， -1190， 尾盘收在-1190 附近； 9S 成在-1493； 1Y 早上成在-2126， 2130， 后面买到-2107， -2100， 然后又给到-2111 附近， 最后又买到-2095， -2090， -2085， -2083， 最后收在-2077 附近。

Spread 方面， 2w*3w 成交在-81.5; 1s*3s 成交在-407;3s*4s 成交-201， -200； 3s*6s 成交在—557~-556; 4s*5s 成交在-191~-189.5； 5s*6s 成交在-165， -160； 6s*1y 成交在-920,-910,-900； 9s*1y 成交在-415， -414。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1078	0.45
2W	14	-105	7.1026	0
1M	32	-236	7.0895	11
2M	61	-443	7.0688	5
3M	91	-642	7.0489	12
6M	181	-1190	6.9941	40
9M	273	-1678	6.9453	67
1Y	367	-2084	6.9047	96
18M	546	-2660	6.8471	110
2Y	731	-3050	6.8081	160
3Y	1095	-4000	6.7131	105
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1182	
CLOSING SPOT RATE			7.1131	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-207.05	-406	-954	-1442	-1848
2M		-198.95	-746.95	-1234.95	-1640.95
3M			-548	-1036	-1442
6M				-488	-894
9M					-406



文 / Edison Zeng

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