



【2024-09-10】

今日美元/人民币中间价报 7.1136，较上一个交易日上调 147bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 成交在-7.2~-6.5 之间；TN 成交在-7.83~-6.95 之间，尾盘收在-7.2 附近；SN 成交在-7.9~-7.6 之间，尾盘收在-7.55 附近。

1W 成交在-54~-53.3 之间；2W 成交在-107 之间；3W 成交在-195.5~-195 之间。1S 成交在-246.2~-246 之间；2S 成交在-453~-448 附近；3S 反复成交在-654.5~-653 之间；5S 成交在-1058 附近。

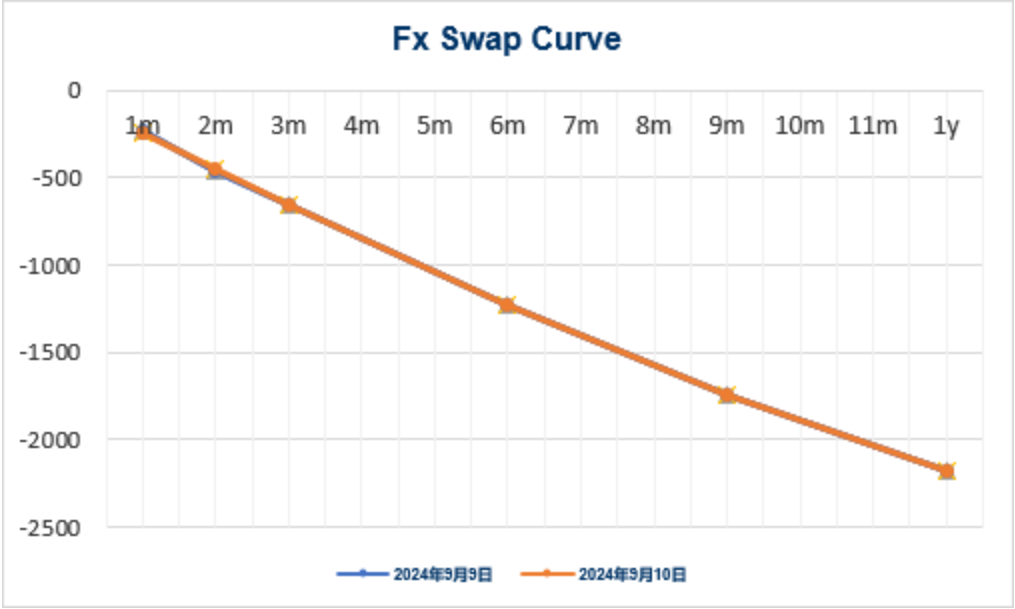
中长期限，6S 从-1234 买到-1228，尾盘收在-1227 附近；9S 从-1750 买到-1731，尾盘给回-1738 附近；1Y 从-2220 买到-2163，尾盘给回-2177 附近。

超长期限，18S 成交在-2780，3Y 成交在-4100。

Spread 方面，3W*1S 成交在-52，1*3S 成交在-408，6*9S 成交-515，6*12S 成交在-968、-957、-953、-950，9*12S 成交在-433。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-54	7.1181	1.85
2W	14	-105	7.1130	4
1M	26	-247	7.0988	-19.6
2M	61	-448	7.0787	11
3M	91	-654	7.0581	3
6M	181	-1230	7.0005	-2
9M	273	-1745	6.9490	1
1Y	365	-2180	6.9055	0
18M	546	-2770	6.8465	-30
2Y	732	-3210	6.8025	-5
3Y	1096	-4105	6.7130	10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1136	
CLOSING SPOT RATE			7.1234	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-201	-407	-983	-1498	-1933
2M		-206	-782	-1297	-1732
3M			-576	-1091	-1526
6M				-515	-950
9M					-435



文 / Edward Sun

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