



【2024-10-23】

今日美元/人民币中间价报 7.1245，较上一个交易日上调 22bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 早盘从 -6.15 给到 -6.2，午后成交在 -6.2；TN 早盘从 -5.88 给到 -5.96，午后从 -6.03 给到 -6.18；SN 成交在 -18.21~-18.18 之间。

1W 从 -42 给到 -42.05、-42.4；2W 反复成交在 -86。1S 从 -190 买到 -189、-188.8；2S 从 -372.5 给到 -374.5；3S 从 -572 买到 -569.5。

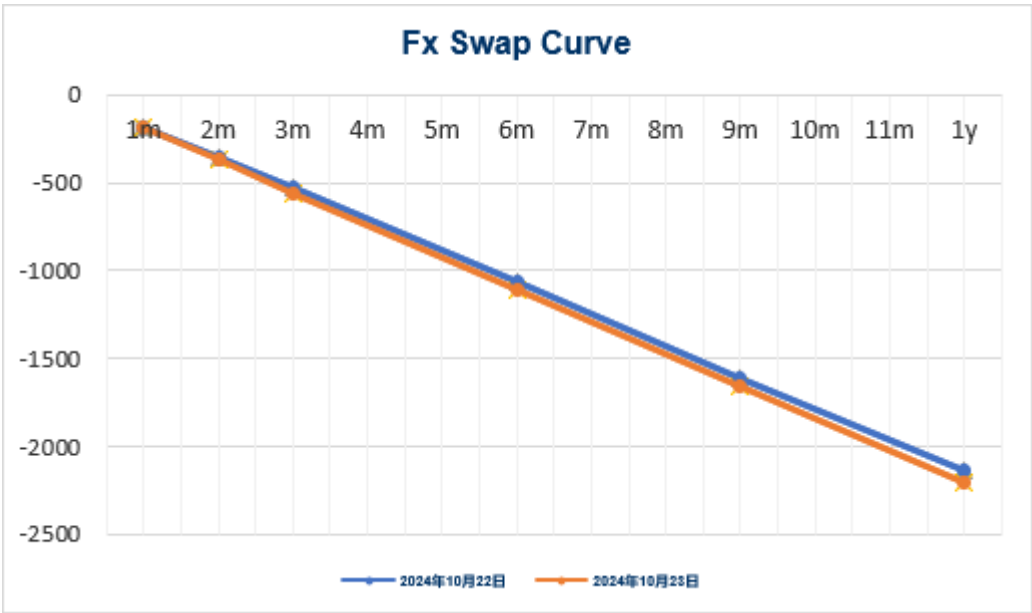
中长期限，6S 从 -1145 买到 -1133、-1125、-1107、-1106、-1105；9S 从 -1697 买到 -1680；1Y 从 -2276 买到 -2200，尾盘收在 -2200。

超长期限，3Y 成交在 -4500。

Spread 方面，1W*2W 成交在 -44、-43.6；1W*3S 成交在 -527.5；1*2S 成交在 -185；3*6S 成交在 -564~-561；5*6S 成交在 -200；9*12S 成交在 -556、-575。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-42	7.1226	-0.77
2W	14	-87	7.1181	-3
1M	31	-188	7.1080	-1.06
2M	62	-374	7.0894	-19
3M	94	-566	7.0702	-39
6M	182	-1105	7.0163	-40
9M	273	-1656	6.9612	-46
1Y	367	-2204	6.9064	-62
18M	549	-3080	6.8188	-200
2Y	731	-3700	6.7568	-246
3Y	1095	-4450	6.6818	-225
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1245	
CLOSING SPOT RATE			7.1268	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-185.56	-377.65	-916.65	-1467.65	-2015.65
2M		-192.09	-731.09	-1282.09	-1830.09
3M			-539	-1090	-1638
6M				-551	-1099
9M					-548



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