



【2024-09-20】

今日美元/人民币中间价报 7.0644，较上一个交易日下调 339bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 成交在-21~-18.95 之间；TN 早盘在-6.34~-6.2 之间反复成交，午后从-6.35 给到-6.44，尾盘收在-6.44；SN 成交在-6.44~-6.32 之间，尾盘收在-6.44。

2W 成交在-87.5~-87 之间。1S 反复成交在-186.5~-185 之间，午后给到-193；2S 从-383 买到-378；3S 成交在-549~-536 附近；4S 从-696.5 买到-691，午后从-686 给到-690、-695、-697、-700、-705。

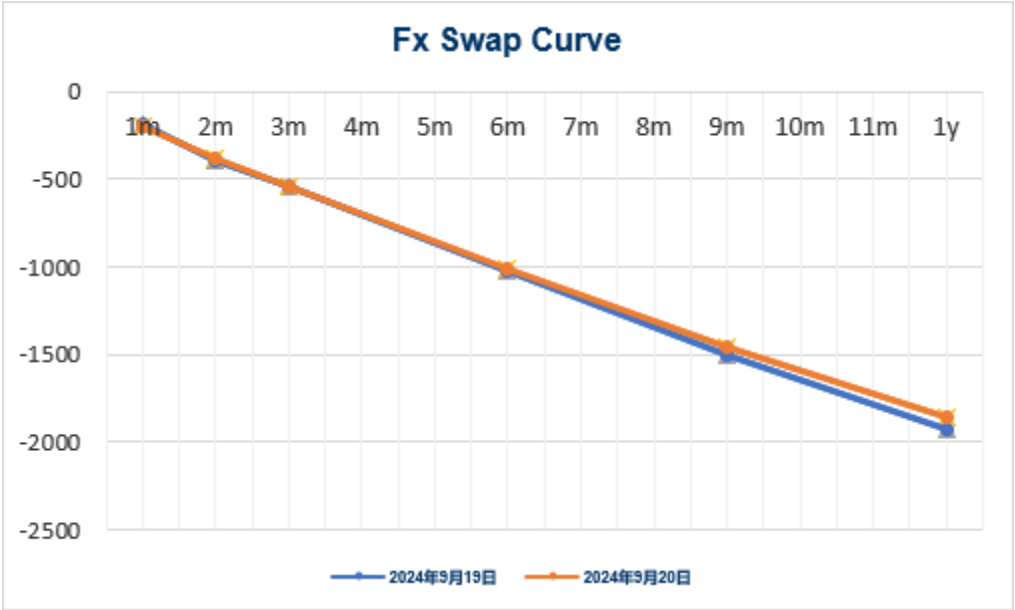
中长期限，6S 从-992 给到过-1000、-1002、-1010；9S 成交在-1480~-1429 附近；1Y 从 1855 买到-1815，后又给回-1860，尾盘收在-1852。

超长期限，18S 成交在-2330，3Y 成交在-3470。

Spread 方面，2W*1S 成交在-99、-98.5，2*3S 成交在-157、-159，3*4S 成交在-151、-153，6*12S 成交在-865。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	14	-89	7.0463	-44.65
2W	14	-89	7.0463	7
1M	30	-193	7.0359	-1.7
2M	62	-385	7.0167	5
3M	91	-547	7.0006	0.5
6M	181	-1012	6.9541	14
9M	273	-1462	6.9090	46
1Y	365	-1855	6.8697	67
18M	546	-2350	6.8202	120
2Y	730	-2725	6.7827	125
3Y	1095	-3530	6.7022	270
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0644	
CLOSING SPOT RATE			7.0552	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-191.4	-353.3	-818.3	-1268.8	-1661.8
2M		-161.9	-626.9	-1077.4	-1470.4
3M			-465	-915.5	-1308.5
6M				-450.5	-843.5
9M					-393



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