



【2024-01-24】

今日美元/人民币中间价报 7.1053，较上一个交易日下调 64bp，各期限收盘价较上一交易日基本持平。

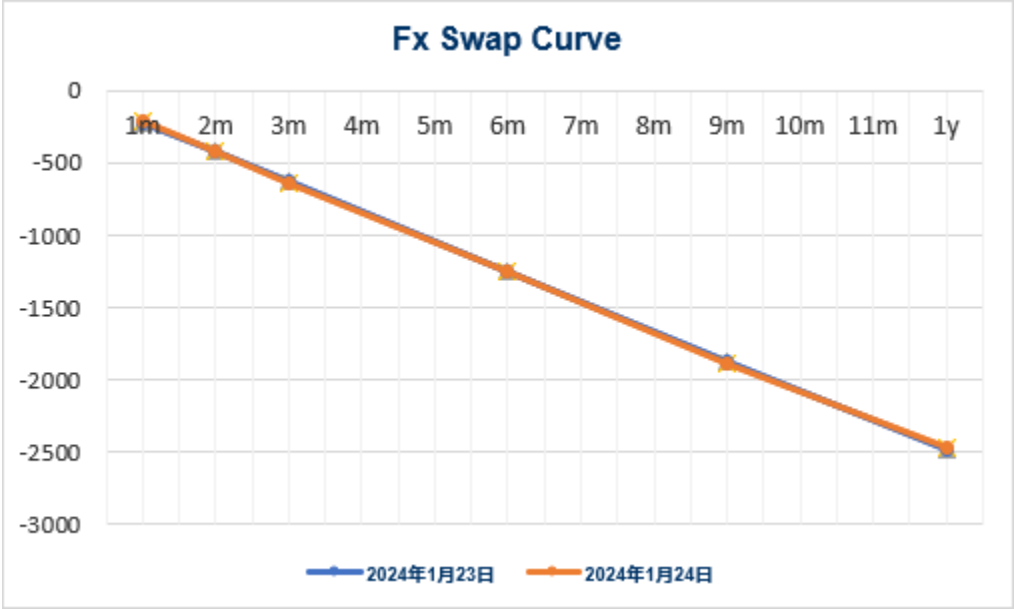
ON 从-6.8 给到-6.85、-6.88、-6.9；TN 从-6.74 一路给到-6.89，后买回-6.87；SN 从-20.2 给到-20.25、-20.3、-20.49。1W 成交在-47.8 附近；2W 成交在-95.3 附近。1S 成交在-214.5 附近；2S 成交在-416 附近；3S 成交在-628 给到过-632、-633.5、-634、-635。

中长期限，6S 成交在-1263~-1261 之间；9S 成交在-1900~-1879 附近；1Y 从-2479 最低给到-2484，后买到过-2483、-2482、-2480、-2470、-2463，尾盘收在-2463。

Spread 方面，3*6S 成交在-627、-629，6*12S 成交在-1217。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.1593	-0.76
2W	14	-97	7.1545	-1
1M	25	-215	7.1427	4.8
2M	60	-416	7.1225	0
3M	91	-635	7.1006	-5.5
6M	182	-1257	7.0384	0
9M	276	-1888	6.9753	-10
1Y	367	-2470	6.9171	9
18M	549	-3320	6.8321	-20
2Y	731	-3950	6.7691	0
3Y	1096	-5000	6.6641	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1053	
CLOSING SPOT RATE			7.1641	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-201.5	-420.5	-1042.5	-1673.5	-2255.5
2M		-219	-841	-1472	-2054
3M			-622	-1253	-1835
6M				-631	-1213
9M					-582



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