



【2024-07-26】

今日美元/人民币中间价报 7.1270，较上一个交易日下调 51bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 成交在-38~-34 之间；TN 从-10.5 一路给到-20.8，后买回-12.4，尾盘收在-12.4 附近；SN 在-19~-14.2 之间来回成交，尾盘收在-14.2。1W 成交在-80~-76 之间；2W 成交在-134 附近。1S 成交在-276；2S 成交在-550~-532 之间；3S 反复成交在-775，尾盘收在-773 附近。

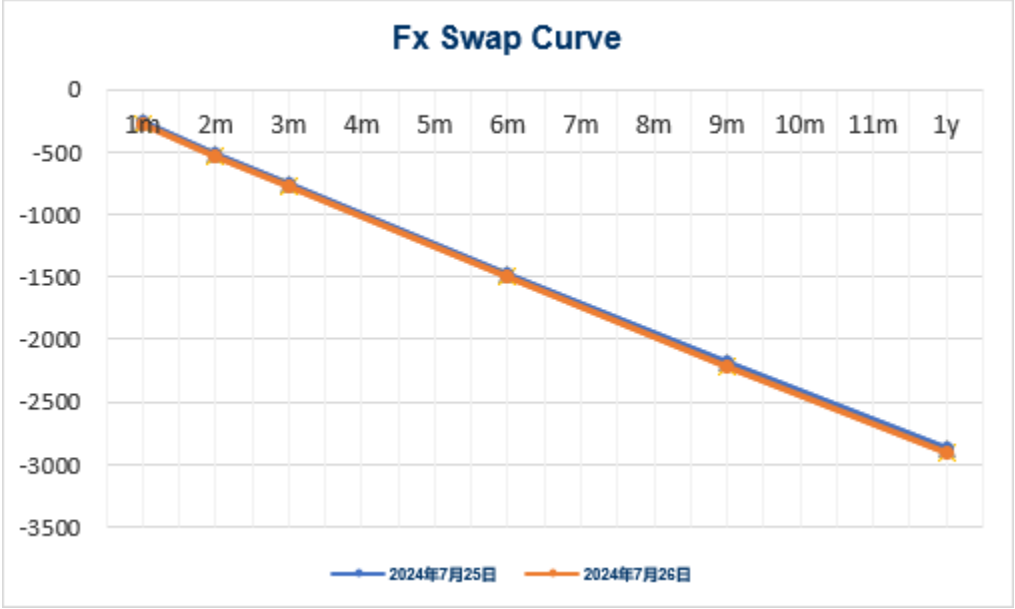
中长期限，6S 在成交在-1505~-1500 之间；9S 成交在-2244~-2220 附近；1Y 从-2920 给到-2925、-2930、-2935，后买回-2920、-2919、-2918。

超长期限，18S 成交在-4025、-4030、-4035；2Y 成交在-4865。

Spread 方面，3*5S 成交在-500，3*6S 成交在-725。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-72	7.2464	-13.76
2W	14	-132	7.2404	-16
1M	31	-270	7.2266	-15.8
2M	62	-530	7.2006	-13
3M	92	-773	7.1763	-20
6M	181	-1498	7.1038	-23
9M	274	-2218	7.0318	-35
1Y	365	-2910	6.9626	-40
18M	549	-4020	6.8516	-40
2Y	730	-4865	6.7671	-115
3Y	1095	-6050	6.6486	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1270	
CLOSING SPOT RATE			7.2536	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-260	-503	-1228	-1948	-2640
2M		-243	-968	-1688	-2380
3M			-725	-1445	-2137
6M				-720	-1412
9M					-692



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