



【2024-09-06】

今日美元/人民币中间价报 7.0925，较上一个交易日下调 64bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

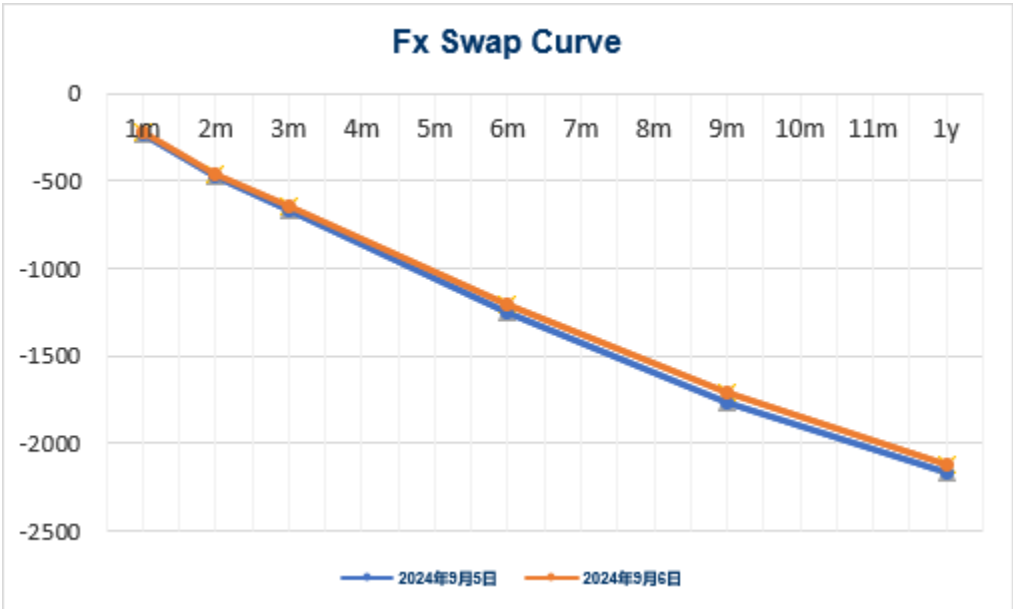
ON 成交在-26.5~-23 之间；TN 从-7.7 给到-8.4；SN 从-7.65 给到-7.9。1W 成交在-63~-61.7 附近；2W 成交在-108.8~-108.2 之间；3W 成交在-212~-207 附近。1S 成交在-226.2~-225 之间；2S 成交在-462~-454.3 附近；3S 反复成交在-650~-648 之间；4S 反复成交在-850~-846 之间。

中长期限，6S 成交在-1219~-1216 之间，尾盘收在-1205 附近；9S 成交在-1720 附近；1Y 从-2140 给到-2143 后买到-2130。

Spread 方面，1W*2W 成交在-45.8，3*4S 成交在-198、-199，3*6S 成交在-565。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-63	7.0819	7.6
2W	14	-108	7.0774	1
1M	28	-226	7.0656	2.2
2M	63	-459	7.0423	16
3M	91	-649	7.0233	13
6M	181	-1208	6.9674	43
9M	273	-1715	6.9168	50
1Y	365	-2125	6.8757	46
18M	546	-2705	6.8177	75
2Y	730	-3150	6.7732	110
3Y	1095	-4125	6.6757	85
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0925	
CLOSING SPOT RATE			7.0882	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-232.6	-422.6	-981.6	-1488.1	-1898.6
2M		-190	-749	-1255.5	-1666
3M			-559	-1065.5	-1476
6M				-506.5	-917
9M					-410.5



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