

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-04-29】

今日美元/人民币中间价报 7.1066，较上一个交易日上调 10bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

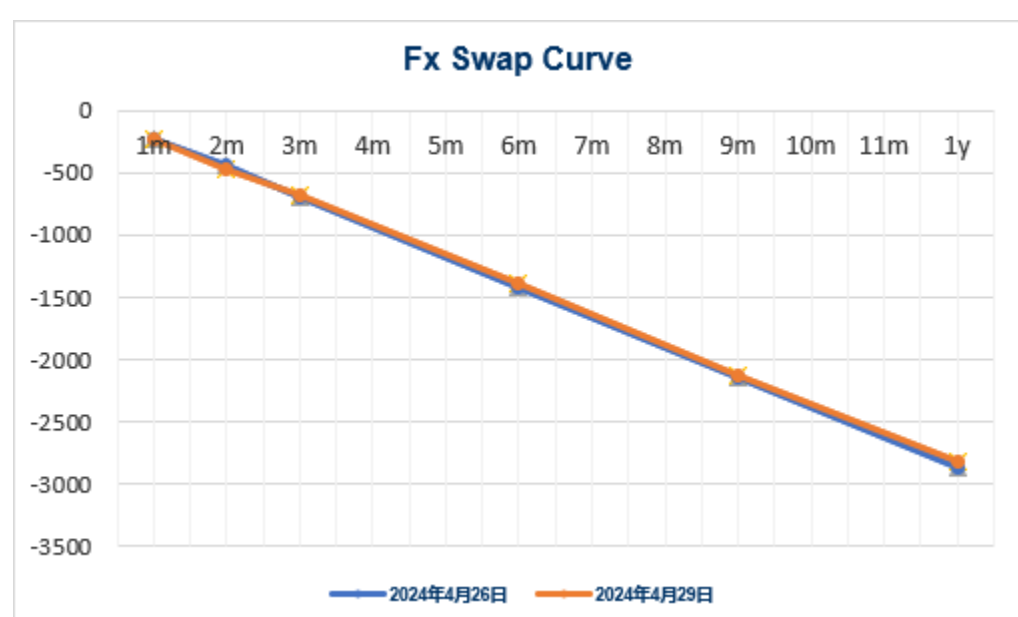
ON 成交在-6.8~-6.75 之间；TN 成交在-47.5~43 之间；SN 成交在-7.3~-7.25 之间。1W 成交在-51~-50.8 之间。1S 成交在-228~-227 之间；2S 成交在-465~-464 附近；3S 成交在-685~-682 之间。

中长期限，6S 成交在-1403 附近；9S 成交在-2155~-2125 附近；1Y 成交在-2845~-2830 之间。

Spread 方面，3\*6S 成交在-720，6\*9S 成交在-743，9\*12S 成交在-697。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-51	7.2416	0.71
2W	14	-102	7.2365	2
1M	31	-226	7.2241	4.3
2M	64	-464	7.2003	-21
3M	92	-682	7.1785	12.5
6M	184	-1395	7.1072	32
9M	276	-2133	7.0334	11
1Y	365	-2828	6.9639	42
18M	547	-4025	6.8442	55
2Y	730	-4915	6.7552	85
3Y	1095	-6150	6.6317	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1066	
CLOSING SPOT RATE			7.2467	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-238	-456	-1169	-1907	-2602
2M		-218	-931	-1669	-2364
3M			-713	-1451	-2146
6M				-738	-1433
9M					-695



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**