



【2024-04-12】

今日美元/人民币中间价报 7.0957，较上一个交易日下调 1bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

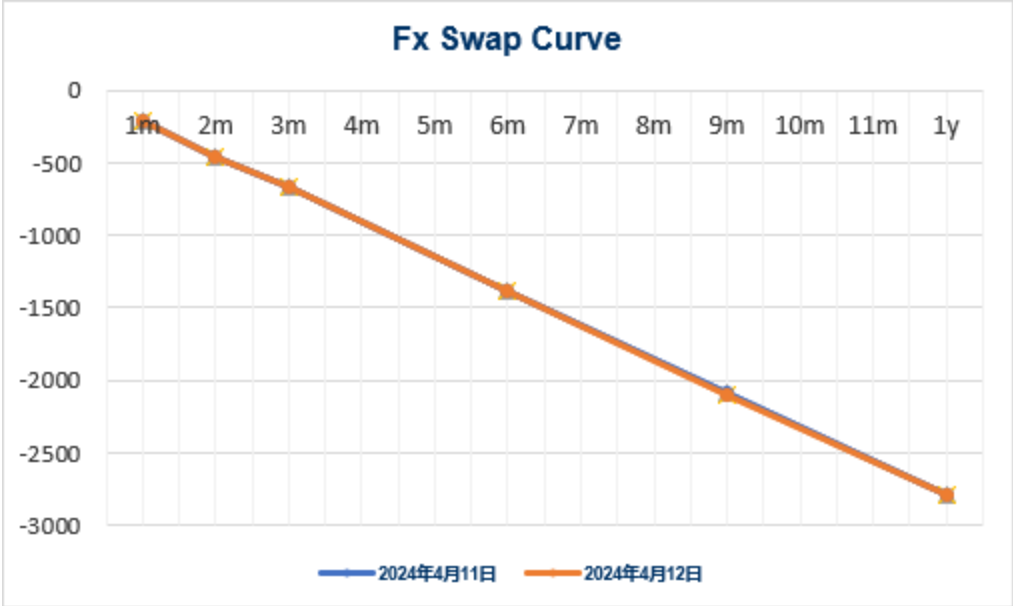
ON 成交在-21.1~-20.5 之间；TN 成交在-7.19~-7.05 之间，尾盘收在-7.05 附近；SN 成交在-7.15~-7.12 之间。1W 成交在-50~-49.8 之间。1S 成交在-218~-217.5 之间；2S 成交在-454~-452 附近；3S 成交在-671~-670 之间。

中长期限，6S 成交在-1381、-1380；9S 成交在-2100；1Y 从-2793 一路给到-2803，后又买回-2795，尾盘收在-2795。

Spread 方面，3*6S 成交在-709、-708，6*9S 成交在-720，9*12S 成交在-697.5，1*2Y 成交在-1956。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.2325	0.32
2W	14	-100	7.2275	0
1M	30	-217	7.2158	0.3
2M	62	-453	7.1922	6
3M	91	-670	7.1706	-2.5
6M	183	-1378	7.0997	-1
9M	275	-2095	7.0280	-4
1Y	365	-2793	6.9582	-8
18M	548	-3940	6.8435	-35
2Y	730	-4760	6.7615	-10
3Y	1095	-5950	6.6425	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0967	
CLOSING SPOT RATE			7.2375	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-236	-452.5	-1161	-1878	-2576
2M		-216.5	-925	-1642	-2340
3M			-708.5	-1425.5	-2123.5
6M				-717	-1415
9M					-698



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