



【2024-09-30】

今日美元/人民币中间价报 7.0074，较上一个交易日下调 27bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 成交在 -35~-15 之间；TN 成交在-8~-6.5；SN 成交在 -7.5~-6.8 之间。

1w 成交在-49，-48，-47 的位置，午后买到-46.1；2W 成交在 -91~-90 之间；3w 成交在-137~-135。1S 反复成交在 -223~-217 之间，午后买到-214.5；2S 从-376 买到-370；3S 成交在-555，-551，-550，-549，-547，-545，-543 附近。

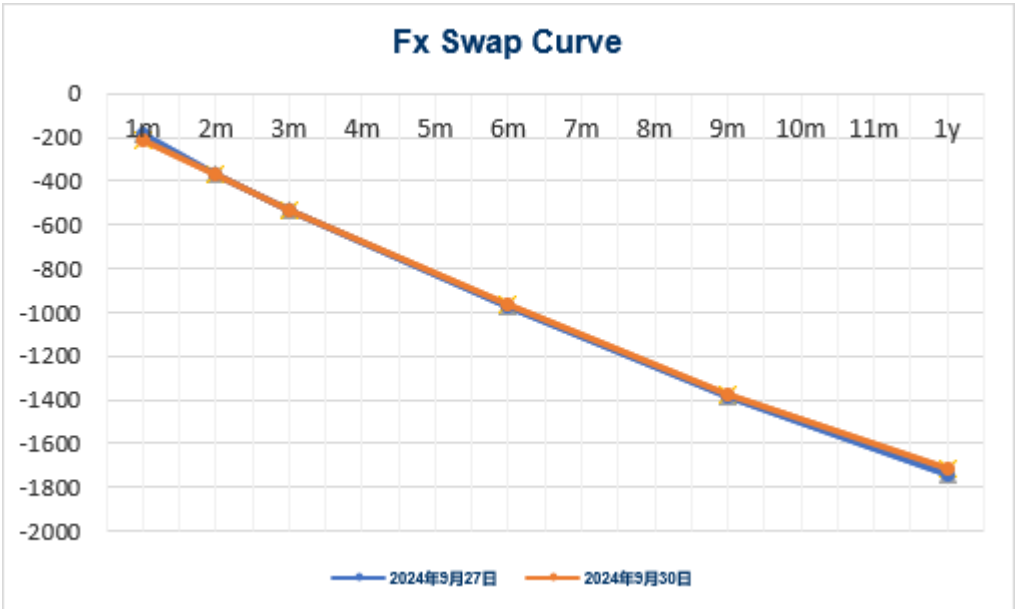
中长期限，6S 从-971，-970，-968，-967，买到过-966；9S 成交在-1395，-1394，-1393，-1390，-1388，-1383，-1375，附近；1Y 从-1750 买到-1725，午后又买到 -1710，尾盘收在 -1705。

超长期限，2y 成交在-2610，-2580，-2570；3y 成交在-3190 的位置。

Spread 方面，3w*1s 成交在-84.5。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-46	7.0110	-1
2W	14	-90	7.0066	-3
1M	34	-210	6.9946	-20
2M	61	-366	6.9790	3
3M	92	-530	6.9626	4
6M	182	-964	6.9192	9
9M	273	-1376	6.8780	14
1Y	365	-1715	6.8441	30
18M	547	-2185	6.7971	115
2Y	730	-2550	6.7606	0
3Y	1098	-3190	6.6966	160
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0074	
CLOSING SPOT RATE			7.0156	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-156	-320	-754	-1166	-1505
2M		-164	-598	-1010	-1349
3M			-434	-846	-1185
6M				-412	-751
9M					-339



文 / Ray Yan

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