



【2024-09-24】

今日美元/人民币中间价报 7.0510，较上一个交易日下调 21 个 bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-6.8， -6.7， -6.75； T/N 成交在-7.05~-6.4； S/N 成交在-7.13~-6.95； 1w 成交在-84.8； 2w 成交在-98； 1s 成交在-218.5， -218， -217.7； 3s 成交在-574， -570； 5s 成交在-900。

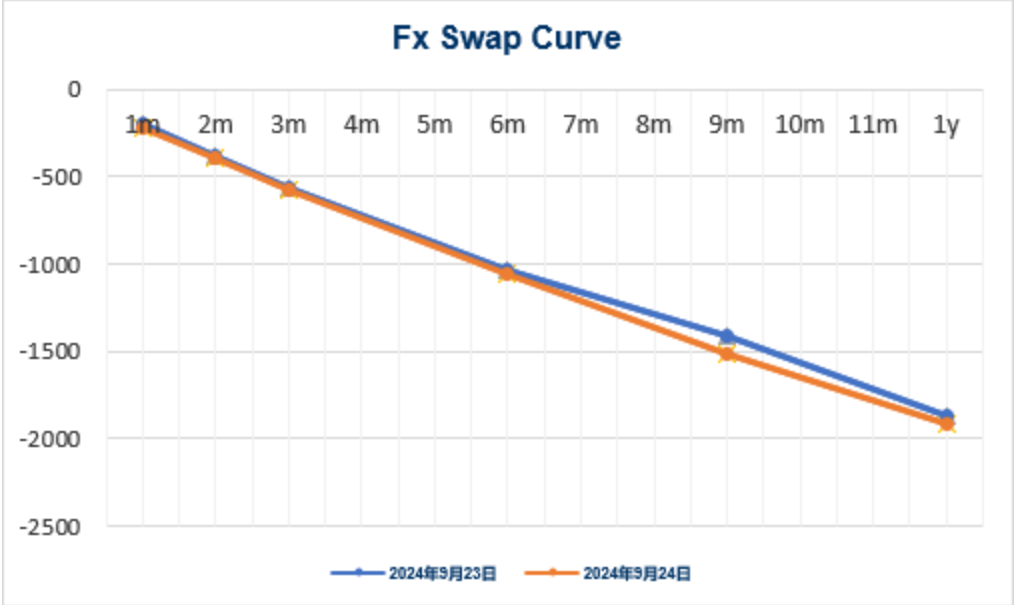
中长期限，6s 成交在-1060， -1047； 1y 成交在-1915， -1905， -1908， -1900， 又给到-1915， -1920， 后面又买到-1905， 最后收在-1908 附近。

超长期限，2y 成交在-2800， 3y 成在-3560。

Spread 方面， 6s*1y 成交在-863， -861， -860。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	12	-82	7.0303	3.96
2W	14	-97	7.0288	-4
1M	32	-217	7.0168	-20.7
2M	61	-397	6.9988	-12
3M	91	-573	6.9812	-10
6M	181	-1057	6.9328	-18
9M	273	-1512	6.8873	-96
1Y	365	-1912	6.8473	-44
18M	546	-2420	6.7965	-20
2Y	732	-2810	6.7575	-10
3Y	1096	-3530	6.6855	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0510	
CLOSING SPOT RATE			7.0385	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-180	-356	-840	-1295	-1695
2M		-176	-660	-1115	-1515
3M			-484	-939	-1339
6M				-455	-855
9M					-400



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