



【2024-07-09】

今日美元/人民币中间价报 7.1310，较上一个交易日上调 24bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 反复成交在-7.3、-7.35；TN 在-7.3~-7.25 之间来回成交，尾盘收在-7.27；SN 成交在-7.3~-7.29 之间。1W 成交在-51.4 附近；3W 成交在-157 附近。1S 成交在-243.3~-243.1 之间；2S 成交在-482~-480 附近；3S 成交在-725 附近。

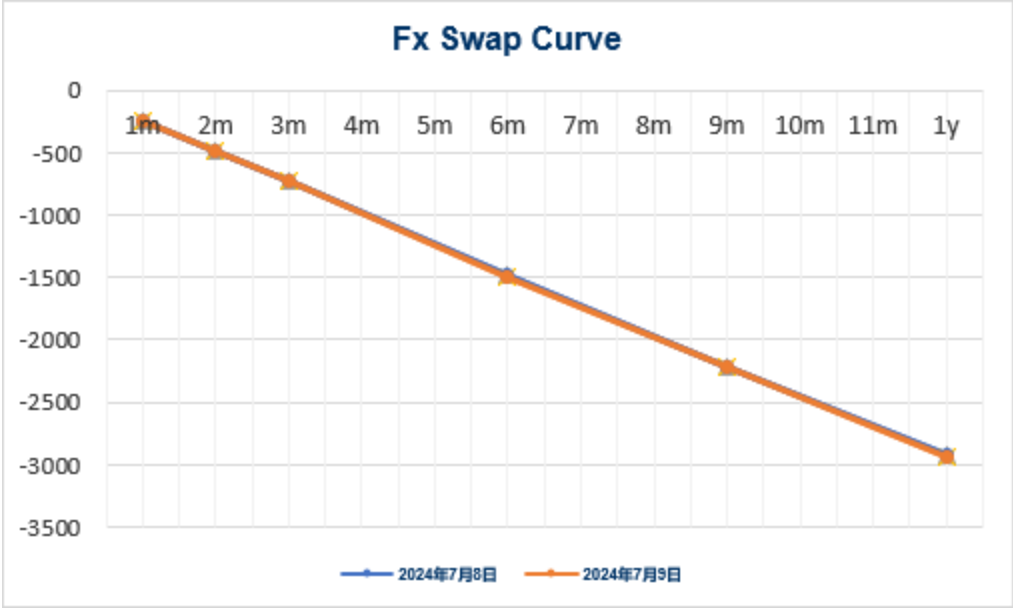
中长期限，6S 成交在-1495~-1494 之间，尾盘收在-1495；9S 成交在-2225~-2219 附近；1Y 从-2928 给到过-2933、-2938，后又买回过-2936、-2937。

超长期限，18S 成交在-4130，3Y 成交在-5990。

Spread 方面，3*4S 成交在-260，3*6S 成交在-770，4*5S 成交在-238、-236，6*12S 成交在-1443、-1441。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2668	-0.18
2W	14	-104	7.2616	0
1M	32	-244	7.2477	7.5
2M	62	-482	7.2238	-1
3M	92	-725	7.1996	-1.7
6M	186	-1495	7.1225	-23
9M	274	-2222	7.0498	-9
1Y	365	-2937	6.9783	-11
18M	550	-4140	6.8580	-35
2Y	732	-5010	6.7710	-60
3Y	1096	-5990	6.6730	-15
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1310	
CLOSING SPOT RATE			7.2720	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-238.5	-481	-1251.5	-1978.5	-2693.5
2M		-242.5	-1013	-1740	-2455
3M			-770.5	-1497.5	-2212.5
6M				-727	-1442
9M					-715



文 / Cathy He

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