



【2024-02-08】

今日美元/人民币中间价报 7.1063，较上一个交易日上调 14bp，各期限收盘价较上一交易日略微下行。

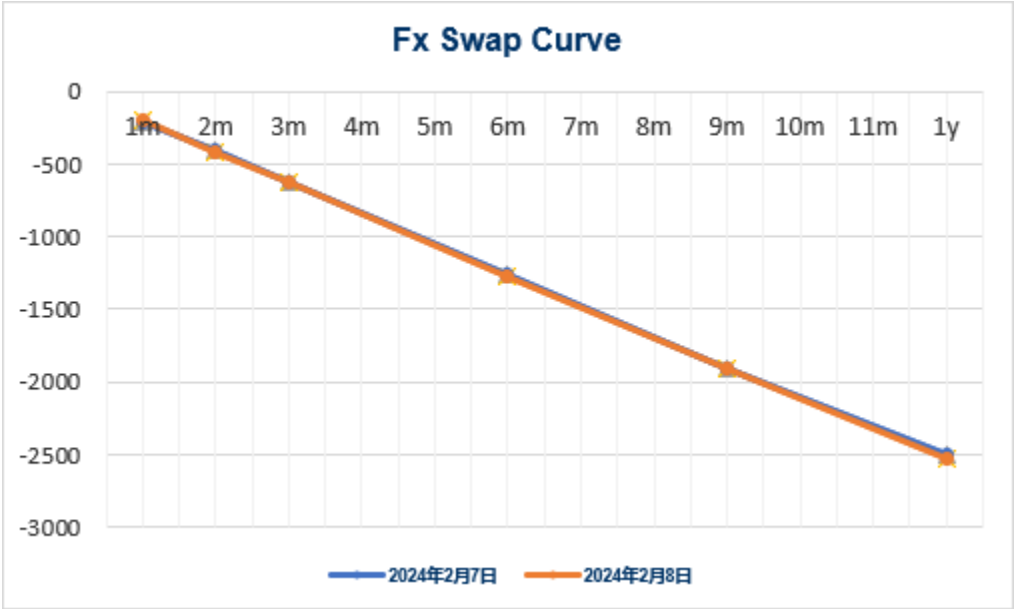
ON 从-6.3 买到-6.2、-6、-5.95；TN 从-66.5 一路买到-64，午后买到-53，市场最高买到-44；SN 从-6.65 买到-6.5、-6.4、-6.2、-6、-5.95、-5.75。1W 从-46 买到-45、-44、-43、-42.5；2W 成交在-91~-89 之间。1S 成交在-192~-190 附近；2S 成交在-421；3S 成交在-621~-619 附近。

中长期限，6S 成交在-1270 附近；9S 成交在-1911~-1909 附近；1Y 成交在-2518~-2513 之间。

Spread 方面，1W*2W 成交在 46、-46.6；3W*2S 成交在-284.5。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	7.1918	28.2
2W	14	-90	7.1871	1
1M	29	-191	7.1770	14.25
2M	62	-421	7.1540	-13
3M	90	-619	7.1342	-1
6M	182	-1268	7.0693	-14
9M	274	-1908	7.0053	-3
1Y	366	-2524	6.9437	-19
18M	547	-3460	6.8501	-65
2Y	734	-4180	6.7781	-105
3Y	1098	-5300	6.6661	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1063	
CLOSING SPOT RATE			7.1961	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-229.95	-427.95	-1076.95	-1716.95	-2332.95
2M		-198	-847	-1487	-2103
3M			-649	-1289	-1905
6M				-640	-1256
9M					-616



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