



【2024-07-19】

今日美元/人民币中间价报 7.1315，较上一个交易日上调 30bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

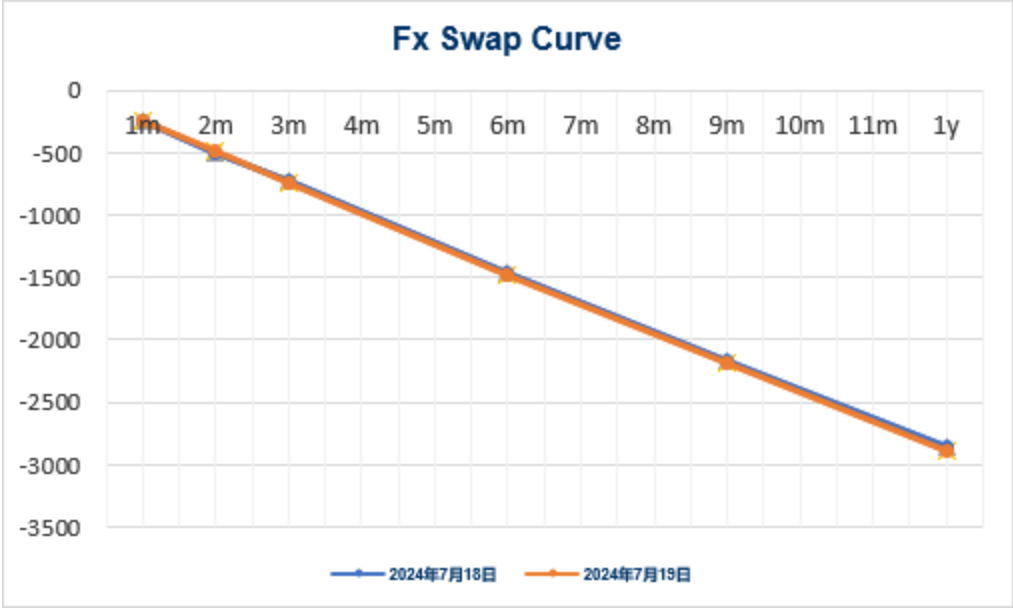
ON 成交在-23.5~-22.5 之间；TN 成交在-8~-7.88 之间，尾盘收在-8；SN 成交在-7.93~-7.9 之间，尾盘收在-7.93。1W 成交在-55.1~-54.8 之间；2W 成交在-110~-109.9 之间。1S 成交在-243；2S 成交在-493；3S 成交在-735~-734 之间；4S 成交在-1000；5S 成交在-1224。

中长期限，6S 在-1480~-1475 之间来回成交；9S 成交在-2191~-2182 之间；1Y 在-2893~-2880 之间来回成交。

Spread 方面，3*4S 成交在-266，4*5S 成交在-224，3*9S 成交在-1455，6*9S 成交在-708，6*12S 成交在-1412、-1409，9*12S 成交在-698。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-55	7.2617	-1.17
2W	14	-110	7.2562	-2
1M	31	-243	7.2429	-1.1
2M	62	-493	7.2179	5
3M	92	-736	7.1936	-5.8
6M	184	-1480	7.1193	-11
9M	274	-2190	7.0482	-22
1Y	365	-2891	6.9781	-26
18M	549	-4010	6.8662	-19
2Y	730	-4895	6.7777	-55
3Y	1095	-5960	6.6712	-40
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1315	
CLOSING SPOT RATE			7.2672	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-249.9	-492.7	-1236.4	-1946.9	-2647.9
2M		-242.8	-986.5	-1697	-2398
3M			-743.7	-1454.2	-2155.2
6M				-710.5	-1411.5
9M					-701



文 / Edward Sun

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