



【2024-10-30】

今日美元/人民币中间价报 7.1390，较上一个交易日上调 107bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 成交在-6.5~-5.8 之间；TN 早上从-5.3 买到过-4.9、-4.85、-4.8、-4.75、-4.71、-4.55、-4.15，午后反复成交在-3.9、-3.8；SN 从-16.9 买到-16.8、-16.75、-16.7，尾盘收在-16.77。1W 成交在-39.3、-39.2；2W 成交在-78.1~-78 附近。1S 成交在-172.5~-170 之间；2S 成交在-353~-351 附近；3S 成交在-545 附近。

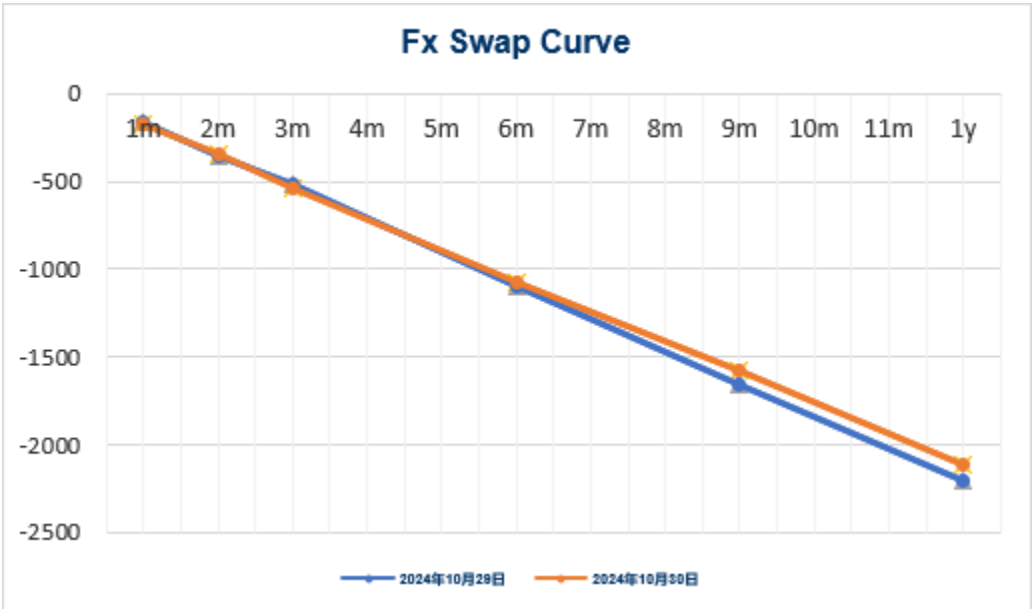
中长期限，6S 成交在-1110~-1069 附近；9S 从-1585 买到-1583；1Y 从 -2110 给到-2120。

超长期限，2Y 成交在-3550。

Spread 方面，2W*3W 成交在-39，6*12S 成交在-1048、-1041。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.1183	1.06
2W	14	-78	7.1144	3
1M	31	-170	7.1052	-3.6
2M	62	-351	7.0871	5
3M	95	-538	7.0684	-17.1
6M	186	-1077	7.0145	21
9M	273	-1580	6.9642	72.5
1Y	367	-2117	6.9105	93
18M	549	-2937	6.8285	113.1
2Y	731	-3510	6.7712	190
3Y	1095	-4460	6.6762	130
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1390	
CLOSING SPOT RATE			7.1222	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-181	-368.1	-907	-1410	-1947
2M		-187.1	-726	-1229	-1766
3M			-538.9	-1041.9	-1578.9
6M				-503	-1040
9M					-537



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