



【2024-08-30】

今日美元/人民币中间价报 7.1124，较上一个交易日下调 175bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 从-27 给到-30.2，午后成交在-29；今日无 TN；SN 从-7.65 给到-7.88。1W 成交在-54~-53.3 附近；2W 成交在-113.5；3W 成交在-155。1S 从-257 买到-254；2S 从-446 买到-444；3S 从-649 买到-638；4S 成交在-841。

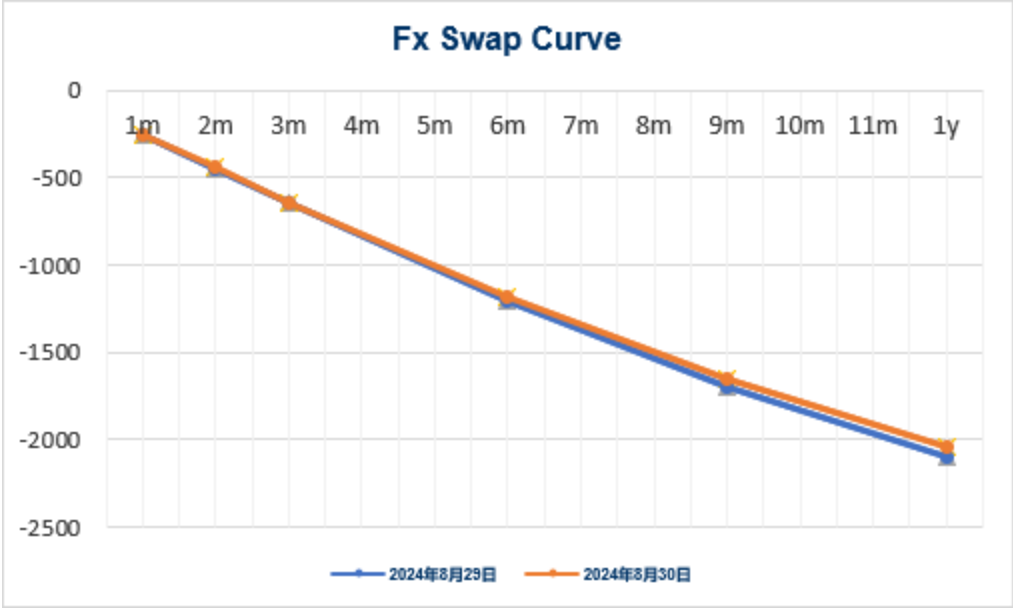
中长期限，6S 从-1204 买到-1185，尾盘收在-1180 附近；9S 成交在-1695~-1690 之间，尾盘收在-1655 附近；1Y 从-2090 买到-2040，尾盘收在-2035 附近。

超长期限，18S 成交在-2600。

Spread 方面，1*2S 成交在-190，1*3S 成交在-384，4*6S 成交在-345。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-54	7.0828	-0.2
2W	15	-113	7.0768	0
1M	35	-253	7.0628	2
2M	62	-444	7.0437	4
3M	91	-639	7.0242	6.5
6M	181	-1180	6.9701	22
9M	273	-1655	6.9226	45
1Y	365	-2037	6.8844	56
18M	546	-2600	6.8281	90
2Y	730	-3000	6.7881	175
3Y	1095	-3950	6.6931	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1124	
CLOSING SPOT RATE			7.0881	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-191	-386	-927	-1402	-1784
2M		-195	-736	-1211	-1593
3M			-541	-1016	-1398
6M				-475	-857
9M					-382



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