



【2024-08-23】

今日美元/人民币中间价报 7.1358，较上一个交易日上调 130bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

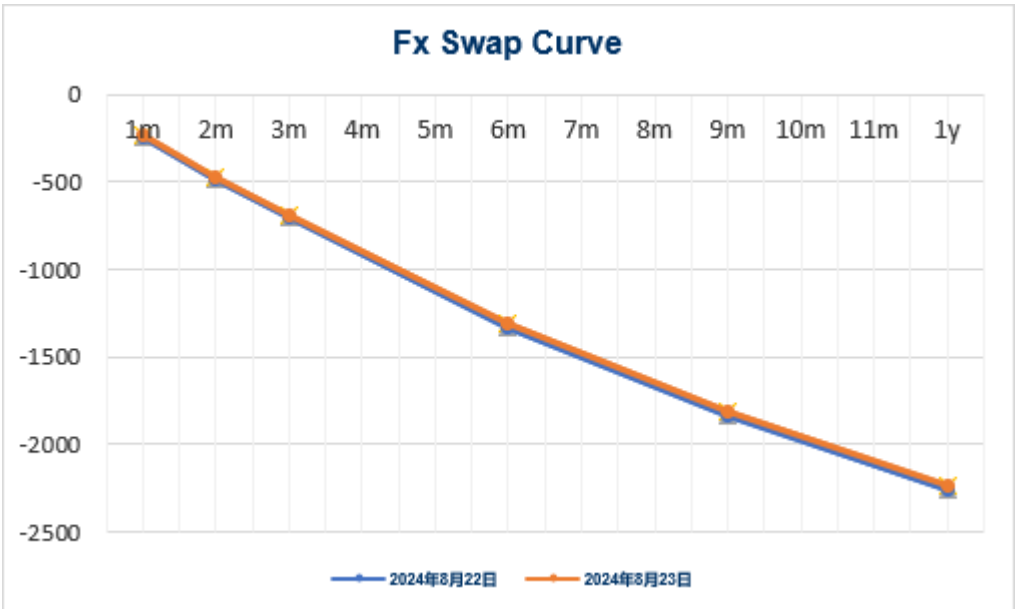
ON 成交在-21.5~-20.3 之间；TN 成交在-7.34~-7 之间，尾盘收在-6.83 附近；SN 成交在-7.38~-7.18 附近。1W 成交在-53.6~-52.8 之间；2W 成交在-108~-106.5 附近。1S 成交在-236；2S 成交在-478~-470 附近；3S 从-705 买到-691；4S 成交在-918。

中长期限，6S 从-1338 买到-1314，尾盘收到-1315 附近；9S 成交在-1824~-1813 之间，尾盘收在-1823 附近；1Y 成交在-2276~-2256 之间。

Spread 方面，3\*6S 成交在-625，4\*6S 成交在-412。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 7    | -53        | 7.1315       | 9.25       |
| 2W                      | 14   | -107       | 7.1261       | 2          |
| 1M                      | 31   | -236       | 7.1132       | 5.5        |
| 2M                      | 62   | -470       | 7.0898       | 19         |
| 3M                      | 92   | -690       | 7.0678       | 16.5       |
| 6M                      | 184  | -1310      | 7.0058       | 17         |
| 9M                      | 273  | -1812      | 6.9556       | 18         |
| 1Y                      | 365  | -2237      | 6.9131       | 19         |
| 18M                     | 549  | -2900      | 6.8468       | 25         |
| 2Y                      | 730  | -3550      | 6.7818       | 25         |
| 3Y                      | 1095 | -4550      | 6.6818       | 50         |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 7.1358       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 7.1368       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |        |        |        |         |         |
|---------------------|--------|--------|--------|---------|---------|
|                     | 2M     | 3M     | 6M     | 9M      | 1Y      |
| 1M                  | -234.4 | -454   | -1074  | -1576   | -2001   |
| 2M                  |        | -219.6 | -839.6 | -1341.6 | -1766.6 |
| 3M                  |        |        | -620   | -1122   | -1547   |
| 6M                  |        |        |        | -502    | -927    |
| 9M                  |        |        |        |         | -425    |



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