



【2024-08-02】

今日美元/人民币中间价报 7.1376，较上一个交易日上调 53bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

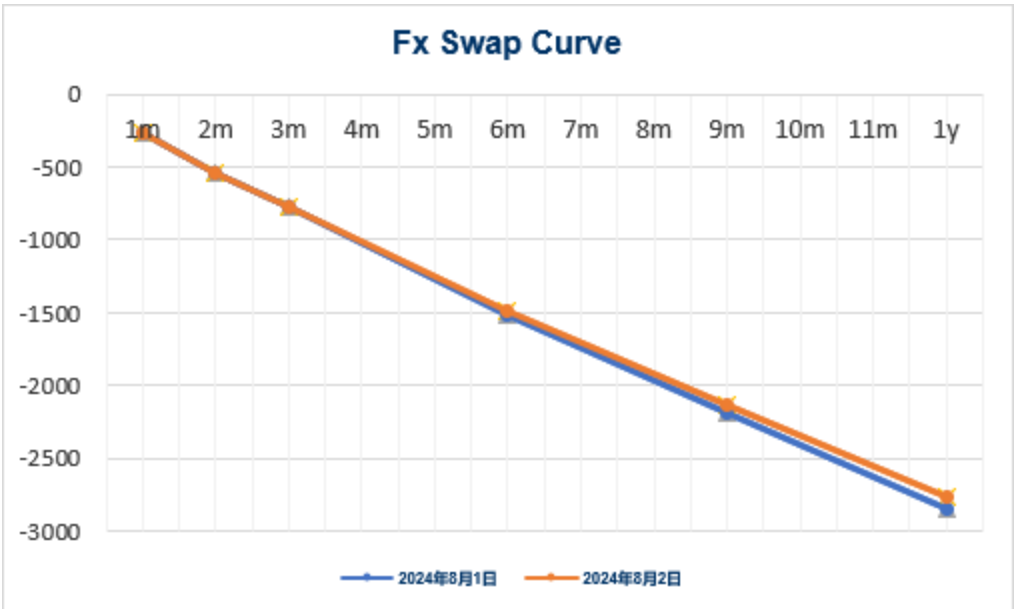
ON 成交在-26~-24.7 之间；TN 从-8.5 买到-8.4，后一路给到-8.88，又买回-8.85，尾盘收在-8.94 附近；SN 成交在-8.7~-8.5 之间。1W 成交在-60 附近；2W 成交在-122 附近。1S 成交在-264~-263.5；2S 成交在-531 附近；3S 成交在-772~-766 附近。

中长期限，6S 从-1495 买到-1492、-1488；9S 成交在-2145，尾盘收在-2131 附近；1Y 从-2793 买到过-2789、-2773、-2772、-2771。

超长期限，18S 成交在-3750、-3730；2Y 成交在-4525、-4515。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-61	7.2089	-2.5
2W	14	-120	7.2030	-2
1M	31	-266	7.1884	-6.1
2M	63	-535	7.1615	5
3M	92	-772	7.1378	-1
6M	184	-1491	7.0659	24
9M	273	-2132	7.0018	58
1Y	365	-2764	6.9386	88
18M	549	-3750	6.8400	130
2Y	730	-4500	6.7650	180
3Y	1095	-5600	6.6550	210
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1376	
CLOSING SPOT RATE			7.2150	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-268.9	-505.9	-1224.9	-1865.9	-2497.9
2M		-237	-956	-1597	-2229
3M			-719	-1360	-1992
6M				-641	-1273
9M					-632



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