



【2024-08-29】

今日美元/人民币中间价报 7.1299，较上一个交易日上调 83bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

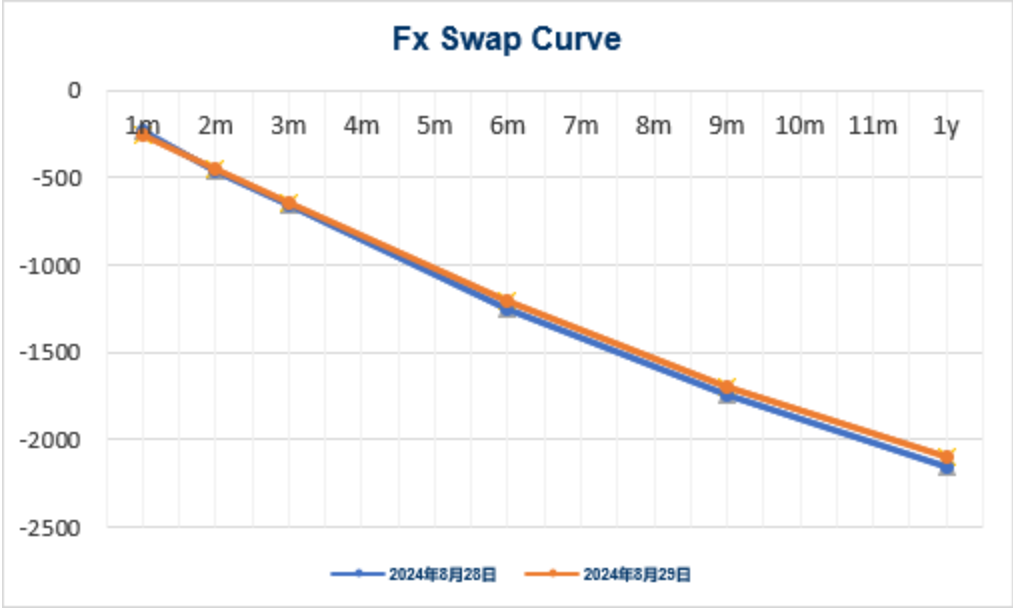
ON 从-7.7 买到-6.8；TN 早盘从-32.6 买到-30，午后从-28.4 买到-27.6，尾盘收在-27.6；SN 成交在-7.6~-7.5 之间。1W 成交在-54~-52 之间；2W 成交在-114~-112 附近；3W 成交在-156~-154 之间，尾盘收在-154。1S 来回成交在-258~-255 之间，尾盘收在-256；2S 成交在-455~-447.5 附近；3S 成交在-647.8~-647 之间，尾盘收在-647。

中长期限，6S 成交在-1208~-1200 之间；9S 成交在-1705~-1693 之间；1Y 早盘成交在-2115~-2105 之间，午后买到-2100 后给回-2105。

Spread 方面，1W*3W 成交在-102.5~-102，3W*1S 成交在-102，4*6S 成交在-352。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.1049	2.2
2W	15	-113	7.0989	-4
1M	35	-255	7.0847	-19
2M	62	-448	7.0654	12
3M	91	-646	7.0457	15.5
6M	181	-1202	6.9900	47
9M	273	-1700	6.9402	47
1Y	365	-2093	6.9009	59
18M	546	-2690	6.8412	85
2Y	730	-3175	6.7927	75
3Y	1095	-4050	6.7052	140
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1299	
CLOSING SPOT RATE			7.1102	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-193	-390.5	-947	-1445	-1838
2M		-197.5	-754	-1252	-1645
3M			-556.5	-1054.5	-1447.5
6M				-498	-891
9M					-393



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