



【2024-08-28】

今日美元/人民币中间价报 7.1216，较上一个交易日下调 33bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 成交在-8.9~-7.8 之间；TN 早盘在-8.68~-8.46 之间来回成交，午后从-8.4 买到-7.6；SN 成交在-36~-33.2 之间。1W 从-57 给到-59 后买回到-55.6；2W 成交在-111 附近。1S 来回成交在-243.5~-236 之间；2S 成交在-474~-458 附近；3S 来回成交在-674~-672 之间。

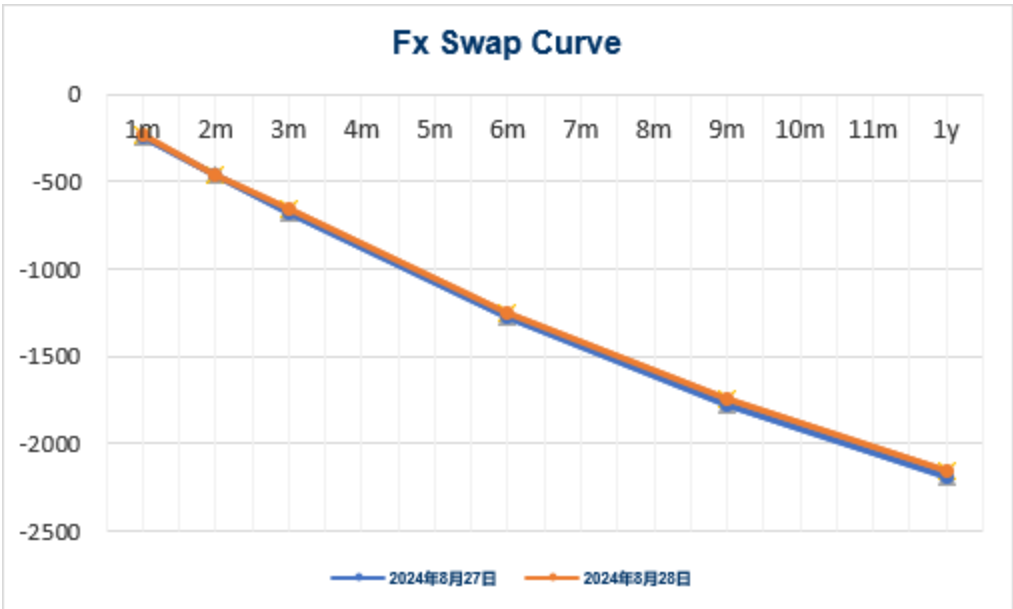
中长期限，6S 从-1272 买到-1263、-1255、-1253；9S 从-1780 买到-1767、-1753；1Y 从-2183 买到-2170、-2162。

超长期限，18S 成交在-2800、-2775、-2755，2Y 成交在-3310。

Spread 方面，6*9S 成交在-502、-503、-500、-498。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-56	7.1205	-0.8
2W	14	-109	7.1151	-1
1M	31	-236	7.1024	9.1
2M	62	-460	7.0800	-2
3M	91	-661	7.0599	19.5
6M	182	-1249	7.0011	29
9M	272	-1747	6.9513	29
1Y	364	-2152	6.9108	40
18M	546	-2775	6.8485	55
2Y	731	-3250	6.8010	50
3Y	1096	-4190	6.7070	125
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1216	
CLOSING SPOT RATE			7.1260	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-224	-425	-1013	-1511	-1916
2M		-201	-789	-1287	-1692
3M			-588	-1086	-1491
6M				-498	-903
9M					-405



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