

常规报告系列



【2024-11-12】

今日美元/人民币中间价报 7.1927，较上一个交易日上调 141bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-5.5~-5.3； T/N 成交在-5.55~-5.5； S/N 成交在-5.6~-5.51； 1w 成交在-39.1， -39， -38.9； 2w 成交在-83； 3w 成交在-； 1s 成交在-177， -176.5； 2s 成交在-341， -340.98； 3s 成交在-525.5， -525， -524。

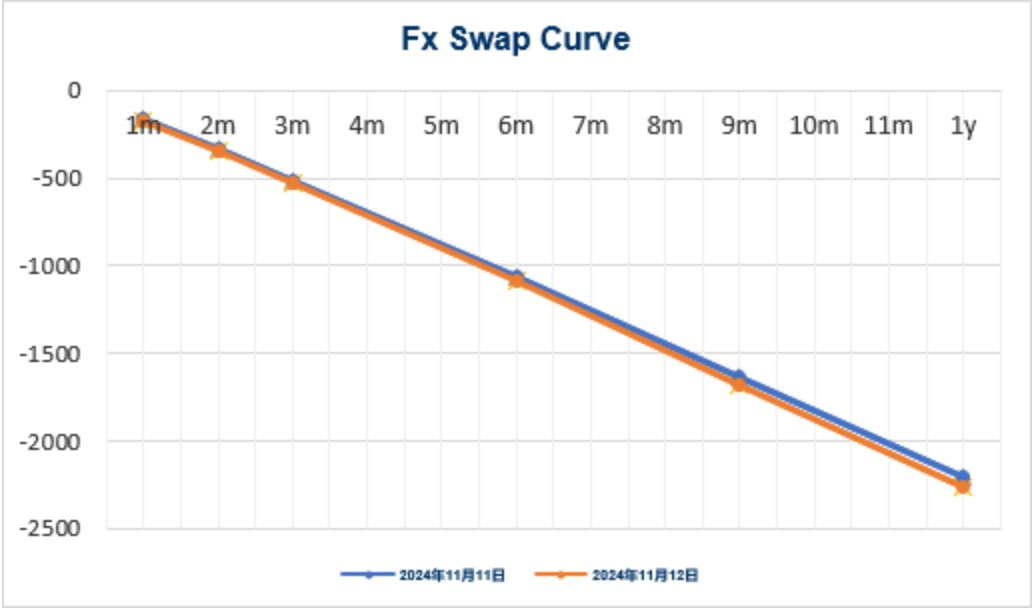
中长期限， 6s 成交在-1090， -1085； 9s 成交在-1670.5， -1669.5， -1667； 1y 成交在-2256， -2265， -2255， -2250， 最后收在-2260 左右。

超长期限， 2y 成交在-3900。

Spread 方面， 无。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.2339	-0.88
2W	15	-83	7.2296	-7
1M	32	-177	7.2201	-13.1
2M	61	-341	7.2037	-7
3M	92	-526	7.1852	-12.5
6M	181	-1090	7.1288	-27
9M	273	-1677	7.0701	-46
1Y	365	-2257	7.0121	-54
18M	546	-3175	6.9203	-125
2Y	732	-3900	6.8478	-170
3Y	1096	-5075	6.7303	-260
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1927	
CLOSING SPOT RATE			7.2378	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-164.38	-349.4	-913.4	-1500.4	-2080.4
2M		-185.02	-749.02	-1336.02	-1916.02
3M			-564	-1151	-1731
6M				-587	-1167
9M					-580



文 / Edison Zeng

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