



【2024-11-20】

今日美元/人民币中间价报 7.1935，较上一个交易日上调 24bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 从-5.9 买到-5.85；TN 从-5.9 给到-5.95、-6.02，尾盘收在-5.91 附近；SN 从-17.7 给到-17.8，尾盘收在-17.78。1W 成交在-41.5、-41；2W 成交在-81.3~-81。1S 成交在-181；2S 成交在-350；3S 成交在-540、-541。

中长期限，6S 成交在-1076、-1077；9S 成交在-1653~-1639 附近；1Y 从-2225 给到-2230，尾盘收在-2240 附近。

Spread 方面，1W*1S 成交在-139.5，1*2S 成交在-169，2*3S 成交在-190，3*6S 成交在-534。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	7.2381	5.75
2W	14	-81	7.2341	-1
1M	31	-181	7.2241	1.9
2M	61	-350	7.2072	-5
3M	94	-542	7.1880	-18
6M	181	-1080	7.1342	-12
9M	273	-1653	7.0769	-20
1Y	367	-2243	7.0179	-42
18M	546	-3155	6.9267	-55
2Y	731	-3930	6.8492	-35
3Y	1095	-5225	6.7197	-135
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1935	
CLOSING SPOT RATE			7.2422	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-169.4	-361.1	-899.1	-1472.1	-2062.1
2M		-191.7	-729.7	-1302.7	-1892.7
3M			-538	-1111	-1701
6M				-573	-1163
9M					-590

