



【2024-11-05】

今日美元/人民币中间价报 7.1016，较上一个交易日下调 187bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-6.2， -6.1， -6； T/N 成交在-6.43~-6.1； S/N 成交在-6.26~-6.1； 1w 成交在-42.1， -42.15， -42.05； 2w 成交在-82.5； 3w 成交在-126； 1s 成交在-181.2； 2s 成交在-343， -341； 3s 成交在-525， -525.8， -527， -526； 4s 成交在-695。

中长期限， 6s 成交在-1068， -1069； 9s 成交在-1611， -1609； 1y 成交在-2142， -2148； 最后收在-2155 附近。

超长期限， 2y 成交在-3600。

Spread 方面， 1w*2w 成交在-43.5； 2w*3w 成交在-43.7； 3s*6s 成交在-542； 6s*9s 成交在-542。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-42	7.1053	-1.76
2W	14	-82	7.1013	-2
1M	32	-181	7.0914	-14.85
2M	61	-345	7.0750	-8
3M	92	-526	7.0570	-6.3
6M	181	-1070	7.0025	-16
9M	273	-1617	6.9478	-25.5
1Y	365	-2150	6.8945	-30
18M	546	-2970	6.8125	-40
2Y	732	-3600	6.7495	25
3Y	1096	-4650	6.6445	10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1016	
CLOSING SPOT RATE			7.1095	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-163.8	-344.3	-888.8	-1435.8	-1968.8
2M		-180.5	-725	-1272	-1805
3M			-544.5	-1091.5	-1624.5
6M				-547	-1080
9M					-533

