



【2024-11-29】

今日 Fixing 定在 7.1877，较上一交易日下调了 17 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅上升。

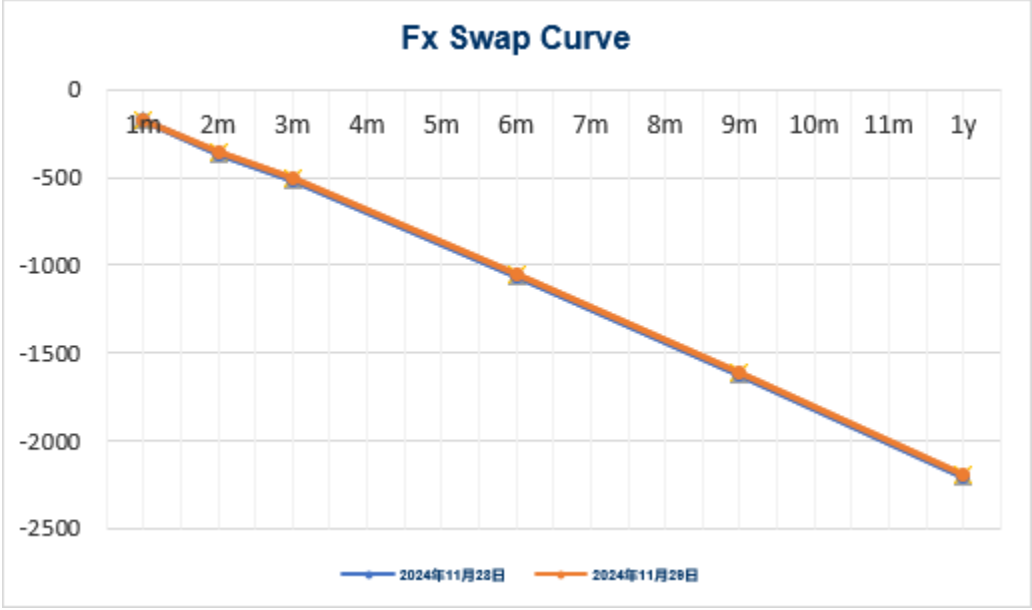
短端，O/N 成交在-18.5~-16.5。T/N 成交在-5.78~-5.63。S/N 成交在-5.8~-5.65。1w 成交在-40.3~-40。2w 成交在-80。1s 成交在-172.5~-171。2s 成交在-356.5~-355.5。3s 成交在-506.5~-505.5，尾盘收在-505.5。5s 成交在-884。

中长期限，6s 成交在-1055~-1048。9s 成交在-1618~-1615。1y 成交在-2193~-2183，尾盘收在-2192。

Spread 上，3*6s 成交在-547。6*12s 成交在-1140~-1137。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.2292	-0.28
2W	14	-81	7.2251	-2
1M	31	-171	7.2162	2.5
2M	64	-356	7.1976	9
3M	90	-506	7.1827	9.5
6M	182	-1053	7.1279	9
9M	310	-1616	7.0716	10
1Y	335	-2193	7.0140	16
18M	547	-3080	6.9252	80
2Y	730	-3870	6.8462	30
3Y	1095	-5000	6.7332	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1877	
CLOSING SPOT RATE			7.2332	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-185.3	-335	-882.5	-1445.5	-2022
2M		-149.7	-697.2	-1260.2	-1836.7
3M			-547.5	-1110.5	-1687
6M				-563	-1139.5
9M					-576.5



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