



【2024-11-27】

今日美元/人民币中间价报 7.1982，较上一个交易日上调 72bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 成交在-12.2~-12 之间；今日无 TN；SN 从-16.75 给到过-17.05、-17.52、-17.6、-17.65，尾盘收在-17.65。1W 成交在-39.3~-39.2 之间；2W 成交在-80~-79 之间。1S 从-178.6 给到-179，尾盘收在-181；2S 从-334 给到-335，反复成交在-334.8；3S 从-521 给到-523。

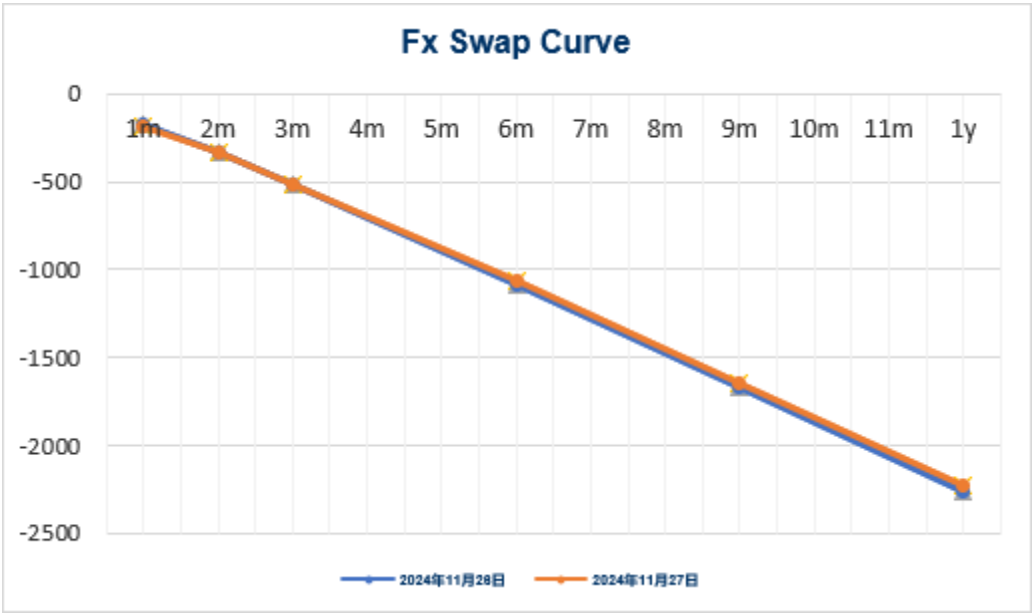
中长期限，6S 成交在-1075.4；9S 成交在-1667、-1666；1Y 从-2270 买到-2265、-2260、-2259、-2247。

超长期限，18S 成交在-3180，2Y 成交在-4000。

Spread 方面，2*3S 成交在-188，3*12S 成交在-1737，6*9S 成交在-584。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.2447	-1.6
2W	14	-80	7.2407	-2
1M	32	-181	7.2306	-3.6
2M	59	-335	7.2153	-4
3M	91	-521	7.1967	-0.8
6M	182	-1068	7.1419	14
9M	305	-1647	7.0840	22
1Y	336	-2230	7.0257	35
18M	546	-3160	6.9327	40
2Y	731	-3955	6.8532	45
3Y	1096	-5110	6.7377	90
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1982	
CLOSING SPOT RATE			7.2487	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-153.3	-339.3	-886.8	-1465.8	-2048.8
2M		-186	-733.5	-1312.5	-1895.5
3M			-547.5	-1126.5	-1709.5
6M				-579	-1162
9M					-583



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