



【2024-11-06】

今日美元/人民币中间价报 7.0993，较上一个交易日下调 23bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 从-6.1 给到-6.2，午后成交一口-6.16；TN 早盘成交在-6.38~-6.35 之间，午后买到-6.05；SN 早盘成交在-25.3~-25.2 之间，午后买到-24.5。
1W 成交在-42.2； 1S 成交在—177~-173 附近；2S 从-345 买到-339；3S 尾盘反复成交在-530。

中长期限，6S 从-1085 买到-1080、-1060；9S 从-1677 买到-1675，尾盘收在-1625 附近；1Y 早盘从 -2230 一路给到-2250，买回-2240 后又一路给到-2260，尾盘收在-2182 附近。

超长期限，18S 成交在-3030、-3060、-3050。

Spread 方面，9*12S 成交在-565、-570。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	7.1608	1.06
2W	14	-81	7.1568	1
1M	31	-173	7.1476	7.9
2M	61	-337	7.1312	8
3M	94	-531	7.1118	-5.5
6M	181	-1065	7.0584	5
9M	273	-1630	7.0019	-13
1Y	367	-2192	6.9457	-42
18M	546	-3060	6.8589	-90
2Y	731	-3700	6.7949	-100
3Y	1095	-4700	6.6949	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0993	
CLOSING SPOT RATE			7.1649	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-163.7	-357.7	-891.7	-1456.7	-2018.7
2M		-194	-728	-1293	-1855
3M			-534	-1099	-1661
6M				-565	-1127
9M					-562

