



【2024-11-26】

今日美元/人民币中间价报 7.1910，较上一个交易日下调 8bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-5.9~-5.65； T/N 成交在-11.29~-11.17； S/N 成交在-17~-16.15； 1w 成交在-39， -38.8， -38.4； 2w 成交在-； 3w 成交在； 1s 成交在-177， -177.7； 2s 成交在-330.7； 3s 成交在-519， 4s 成交在-706， 5s 成交在-891。

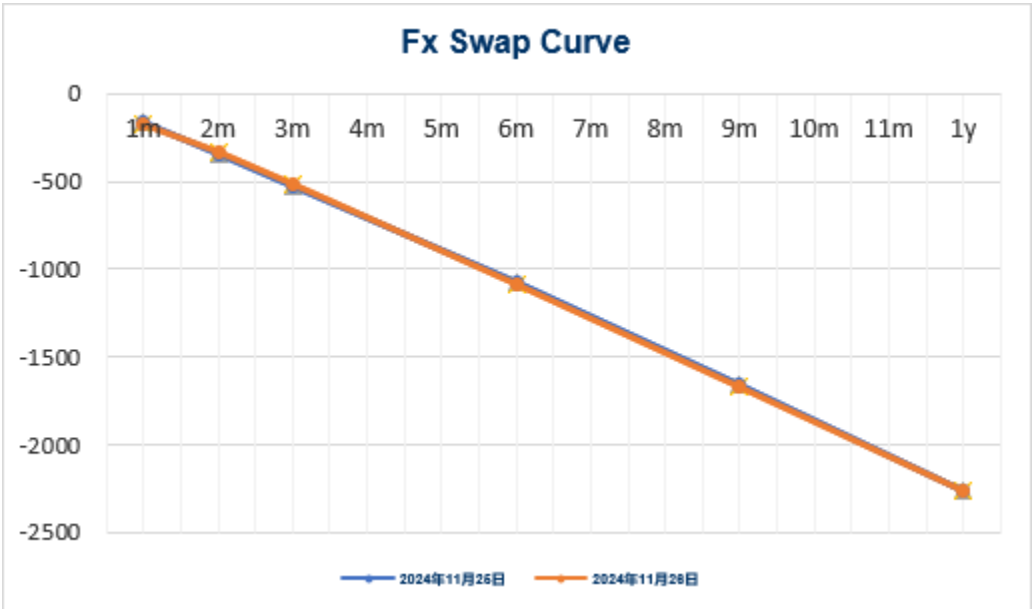
中长期限， 6s 成交在-1082， -1080； 9s 成交在-1667， -1665； 1y 成交在-2250， -2259， -2263， 最后收在-2256 附近。

超长期限， 无。

Spread 方面， 3w*1s 成交在-60.1； 1s*2s 成交在-153； 4s*5s 成交在-185。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.2539	0
2W	14	-78	7.2500	-1
1M	32	-178	7.2400	-9.8
2M	59	-331	7.2247	16
3M	91	-520	7.2058	8.3
6M	182	-1082	7.1496	-7
9M	305	-1669	7.0909	-7
1Y	336	-2265	7.0313	2
18M	546	-3200	6.9378	-10
2Y	731	-4000	6.8578	-20
3Y	1096	-5200	6.7378	-20
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1910	
CLOSING SPOT RATE			7.2578	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-153.2	-342.1	-904.4	-1491.4	-2087.4
2M		-188.9	-751.2	-1338.2	-1934.2
3M			-562.3	-1149.3	-1745.3
6M				-587	-1183
9M					-596



文 / Edison Zeng

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