



【2024-11-19】

今日美元/人民币中间价报 7.1911，较上一个交易日上调 4bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-5.95， -5.85； T/N 成交在-5.98~-5.75； S/N 成交在-5.9~-5.75； 1w 成交在-46.5， -46.97， -46.95； 2w 成交在-78， -78.6； 3w 成交在-119； 1s 成交在-182.7， -182.5， -182； 2s 成交在-345； 3s 成交在-524， -522， -521。

中长期限， 6s 成交在-1068， -1066， -1065， -1063.5； 9s 成交在-1630， -1633， -1632； 1y 成交在-2181， -2200， -2203， -2205 最后收在-2187 左右。

超长期限， 18s 成交在-3100； 2y 成交在-3900， -3895。

Spread 方面， 1w*2w 成交在-32.8； 3w*1s 成交在-63.5； 6s*9s 成交在-568， -565， -564； 9s*1y 成交在-572， -570， -568。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-47	7.2352	-7.05
2W	14	-80	7.2319	-3
1M	32	-183	7.2216	-15.4
2M	61	-345	7.2054	2
3M	92	-524	7.1875	-1
6M	181	-1069	7.1331	3
9M	273	-1633	7.0766	10
1Y	365	-2201	7.0198	21
18M	546	-3100	6.9299	20
2Y	732	-3895	6.8504	-7
3Y	1096	-5090	6.7309	-65
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1911	
CLOSING SPOT RATE			7.2399	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-162.2	-341.2	-885.7	-1450.2	-2018.2
2M		-179	-723.5	-1288	-1856
3M			-544.5	-1109	-1677
6M				-564.5	-1132.5
9M					-568

