



【2024-11-28】

今日 Fixing 定在 7.1894，较上一交易日下降了 88 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所上升，今天交投较活跃。

短端， T/N 主要成交在-18.2~-16.5 的位置。S/N 主要成交在-5.8~-5.5 的位置。1w 成交在-40， -40.1， -40.2， -39.9， -39.85 的位置。2w 成交在-80.3， -80.5， -80， -79.8 等位置。1s 成交在-176， -175， -174.5， -174， -173 等位置。2s 成交在-366， -365 的位置。3s 成交在-518， -517， -515， -513， -514， -515.5 等位置。4s 成交在-692， -691， -690， -690.5 等位置。5s 成交在-893， -892， -890， -891 等位置。

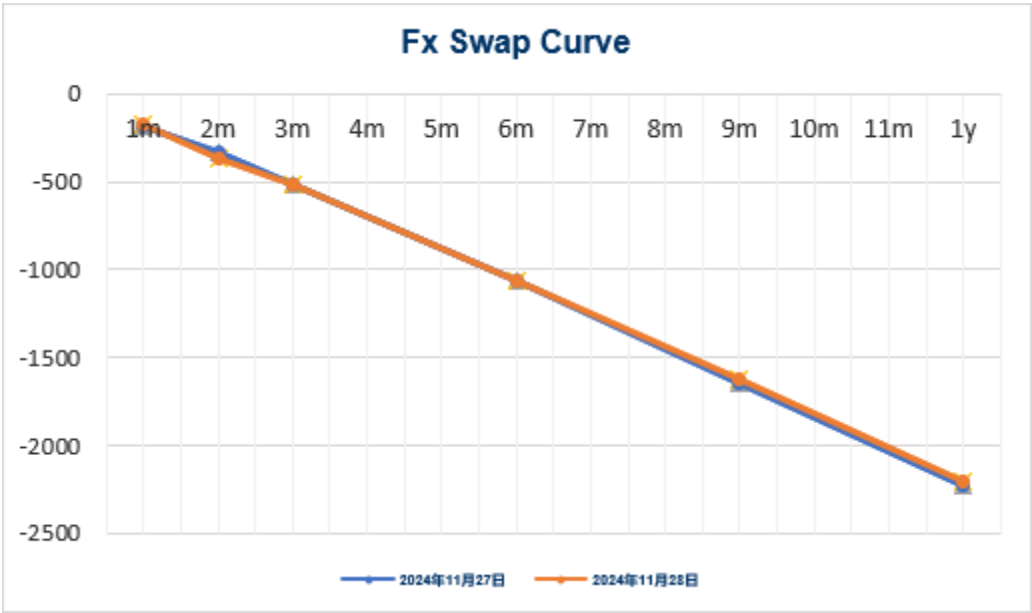
中长期限， 6s 成交在-1065， -1062， -1060， -1058， -1057， -1060， -1063 等位置。9s 成交在-1630， -1625， -1622， -1617， -1620， -1624， -1626， -1627 等位置。1y 成交在-2200， -2198， -2195， -2192， -2190， -2188， -2185， -2190， -2195， -2200， -2202， -2209， -2214 等位置。

超长期限， 2y 成交在-3900， -3880 的位置。

Spread 方面， 1*3s 成交在-338.5 的位置。3*4s 成交在-174 的位置。4*5s 成交在-201 的位置。3*6s 成交在-543 的位置。6*9s 成交在-560， -565 的位置。3*9s 成交在-1103 的位置。9*12s 成交在-575， -582 等位置。6*12s 成交在-1135 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.2485	0.55
2W	14	-79	7.2446	1
1M	31	-173	7.2352	8.2
2M	65	-364	7.2161	-30
3M	91	-515	7.2010	5.5
6M	183	-1062	7.1463	6
9M	311	-1626	7.0899	21
1Y	336	-2208	7.0317	22
18M	547	-3160	6.9365	0
2Y	730	-3900	6.8625	55
3Y	1095	-5100	6.7425	10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1894	
CLOSING SPOT RATE			7.2525	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-191.46	-342	-889	-1453	-2035
2M		-150.54	-697.54	-1261.54	-1843.54
3M			-547	-1111	-1693
6M				-564	-1146
9M					-582



文 / Yiff Wang

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