



【2024-11-25】

今日美元/人民币中间价报 7.1918，较上一个交易日下调 24bp，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

ON 成交在 -5.9~-5.75；TN 成交在 -5.65~-5.53 ； SN 成交在 -11.38~-11.25 之间。

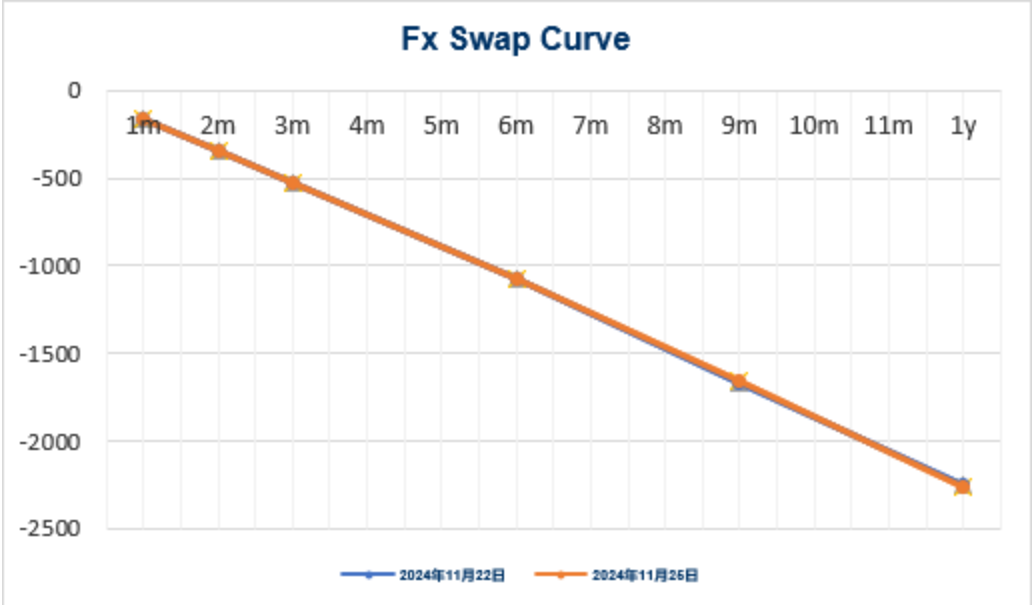
1w 成交在 -38.75,-38.7,-38.65 的位置；2w 成交在 -74.1 的位置； 1S 反复成交在 -168~-167 之间 ； 2S 从 -345 给到 -346 ， 午后又给到 -347 ； 3S 成交在 -531， -530， -529 附近。

中长期限， 6s 成交在 -1074， -1073， -1072 午后买到过 -1070 ， 尾盘收在 -1071 ； 9S 成交在 -1668,-1667， -1665 午后买到过 -1664 附近， 尾盘买到 -1662 附近； 1Y 从 -2265 买到 -2260 附近 ， 午后成交在 -2265， -2264， -2263， -2260 附近， 随后又给到 -2275 附近， 尾盘收在 -2266 。

Spread 方面， 6s*9s*1y 成交在 +10。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.2423	0.2
2W	14	-77	7.2385	2
1M	30	-168	7.2294	0.8
2M	61	-347	7.2115	4
3M	92	-528	7.1934	0.5
6M	181	-1075	7.1387	3
9M	306	-1662	7.0800	4
1Y	366	-2267	7.0195	-16
18M	546	-3190	6.9272	-10
2Y	730	-3980	6.8482	20
3Y	1097	-5180	6.7282	40
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1918	
CLOSING SPOT RATE			7.2462	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-179.2	-360.2	-907.2	-1494.2	-2099.2
2M		-181	-728	-1315	-1920
3M			-547	-1134	-1739
6M				-587	-1192
9M					-605



文 / Ray Yan

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