

常规报告系列



【2024-11-13】

今日美元/人民币中间价报 7.1991，较上一个交易日上调 64bp，各期限收盘价较上一交易日持平。

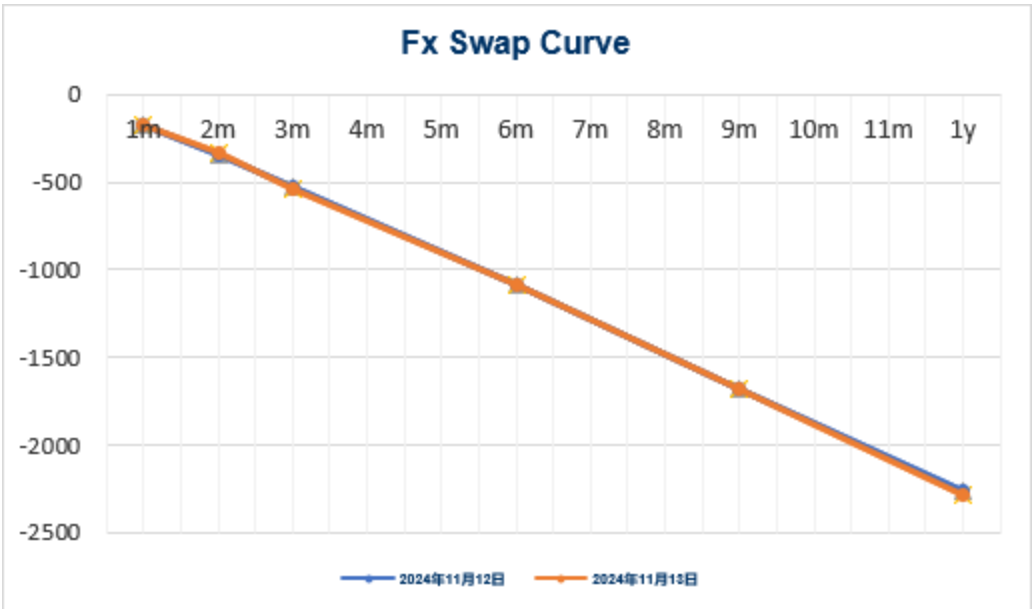
ON 从-5.3 给到过-5.6、-5.7、-5.98、-6；TN 从-5.4 买到-5.38 后给回-5.47，午后从-5.44 给到-5.49；SN 从-16.42 一路给到-16.44、-16.5、-16.75。1W 成交在-40~-35.9 附近；2W 成交在-76~-75 之间。1S 成交在-169、-169.5、-170、-171；2S 成交在-343~-337.5 附近；3S 成交在-539 附近。

中长期限，6S 成交在-1096~-1075 附近，尾盘收在-1085；9S 成交在-1693~-1675 附近，尾盘收在-1683；1Y 在-2290~-2265 之间来回成交，尾盘买在-2286、-2285。

Spread 方面，1W*2S 成交在-300.5，9*12S 成交在-602。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.2213	0.55
2W	14	-77	7.2175	6
1M	31	-169	7.2083	7.59
2M	61	-338	7.1914	3
3M	95	-539	7.1713	-13.3
6M	181	-1085	7.1167	5
9M	273	-1680	7.0572	-3
1Y	367	-2282	6.9970	-25
18M	546	-3205	6.9047	-30
2Y	731	-3950	6.8302	-50
3Y	1095	-5050	6.7202	25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1991	
CLOSING SPOT RATE			7.2252	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-168.99	-370.29	-915.99	-1510.99	-2112.99
2M		-201.3	-747	-1342	-1944
3M			-545.7	-1140.7	-1742.7
6M				-595	-1197
9M					-602



文 / Cathy He

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