常规报告系列

收盘日评
银行间外汇衍生品市场



上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2026-11-04】

今日美元/人民币中间价报 6.7180，较上一个交易日上调 30bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

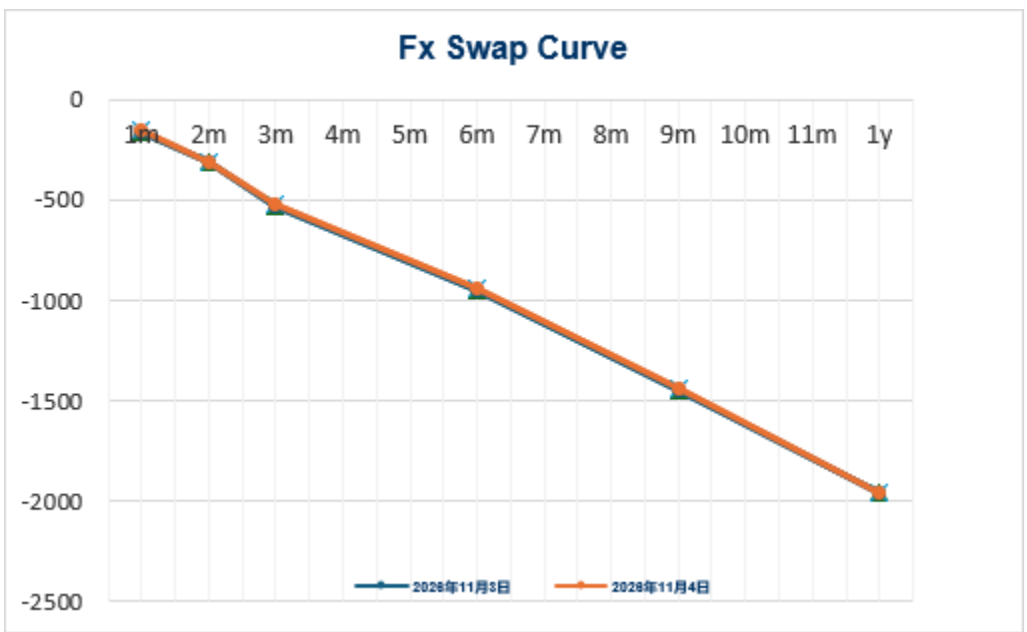
ON 从-5 最高买到过-4.88，后给回-5.1；TN 从开盘-5 给到-5.06，后最高买到-4.99，尾盘收在-4.99；SN 从-15.04 买到-14.96，后给到-14.98。2W 成交在-69.5；3W 成交在-104.5。2S 成交在-310.5~-310 之间。

中长期限，6S 成交在-941 附近；9S 成交在-1443 附近； 1Y 从-1954.4 买到-1950，后给到过-1961、-1963、-1964。

Spread 方面，3*9S 成交在-912.5。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	**7**	-35	6.6735	-0.23
2W	**14**	-69	6.6701	0
1M	**30**	-154	6.6617	4.04
2M	**62**	-311	6.6459	-1
3M	**92**	-524	6.6247	4.15
6M	**184**	-942	6.5829	6
9M	**273**	-1443	6.5327	1.5
1Y	**365**	-1963	6.4808	-10
18M	**547**	-2965	6.3805	15
2Y	**731**	-3970	6.2800	20
3Y	**1098**	-5870	6.0900	30
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7180	
CLOSING SPOT RATE			6.6770	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	**3M**	**6M**	**9M**	**1Y**
1M	-157.5	-370	-788	-1289.5	-1809
2M		-212.5	-630.5	-1132	-1651.5
3M			-418	-919.5	-1439
6M				-501.5	-1021
9M					-519.5



免责声明：本日评由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用日评内容。日评所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，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，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本日评任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。