



【2024-12-04】

今日美元/人民币中间价报 7.1934，较上一个交易日下调 62bp，各期限收盘价较上一交易日持平。

ON 从-6.3 给到-6.35、-6.4、-6.6；TN 早盘在-6.16~-6.13 之间来回成交，午后给到-6.2、-6.3、-6.45，尾盘收在-6.45；SN 从-18.45 给到-18.51、-18.6。1W 成交在-43.4~-43.28 之间；3W 成交在-125.4。1S 从-181 给到-183；2S 成交在-364；3S 成交在-525~-523 附近；5S 成交在-901。

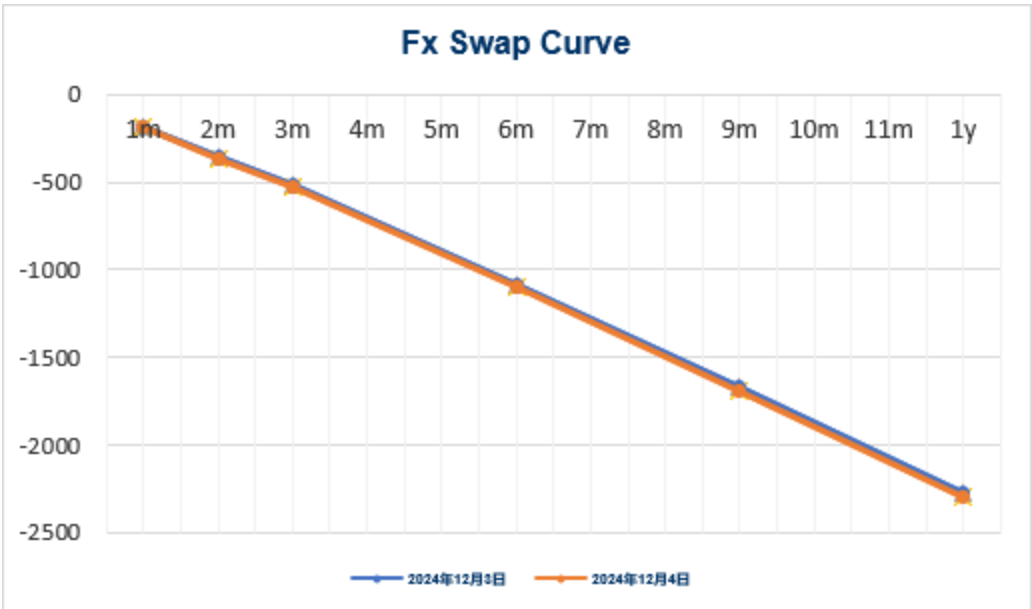
中长期，6S 成交在-1092~-1091 之间，尾盘收在-1095 附近；9S 成交在-1685，尾盘收在-1693 附近；1Y 从-2283 给到-2284、-2288、-2290、-2292，尾盘收在-2294 附近。

超长期限，3Y 成交在-5270。

Spread 方面，3W*1S 成交在-57.5，6*12S 成交在-1190、-1191.6，9*12S 成交在-600。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	7.2644	-1.62
2W	14	-85	7.2603	-2
1M	31	-183	7.2505	3.2
2M	62	-364	7.2324	-7
3M	90	-525	7.2163	-3.5
6M	182	-1095	7.1593	-5
9M	307	-1693	7.0995	-20
1Y	367	-2294	7.0394	-20
18M	549	-3235	6.9453	-25
2Y	731	-4030	6.8658	10
3Y	1095	-5250	6.7438	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1934	
CLOSING SPOT RATE			7.2688	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-181.2	-342.2	-912.2	-1510.2	-2111.2
2M		-161	-731	-1329	-1930
3M			-570	-1168	-1769
6M				-598	-1199
9M					-601



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