



【2024-12-03】

今日美元/人民币中间价报 7.1996，较上一个交易日上调 131bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-6.4， -6.2， -6.1， -6.05； T/N 成交在-6.2~-5.97； S/N 成交在-6.05~-5.95； 1w 成交在-42， -41.75； 1s 成交在-187.4， -186， -185； 2s 成交在-357； 3s 成交在-522； 5s 成交在-905。

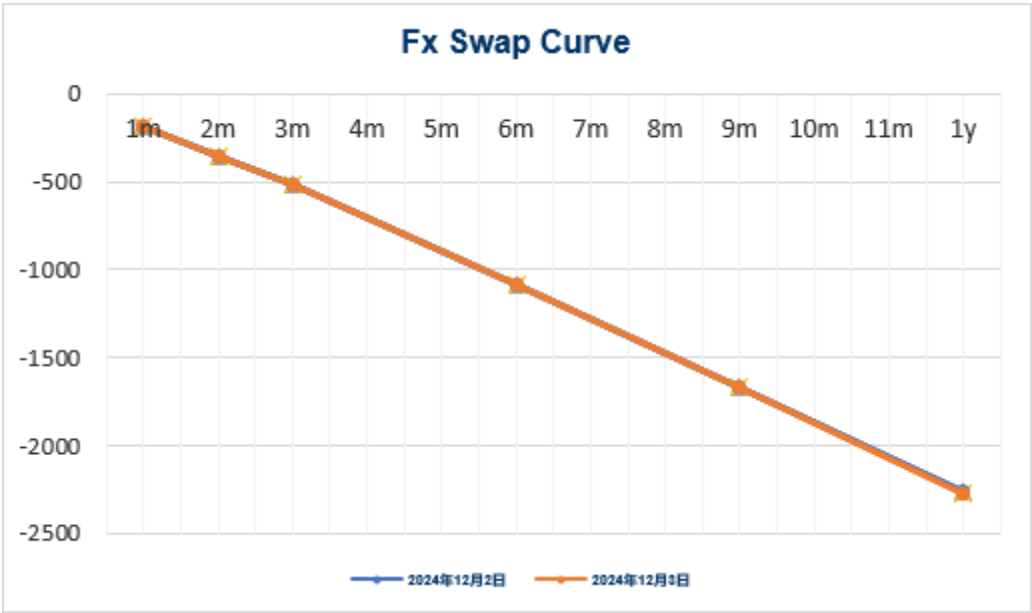
中长期限， 6s 成交在-1060， -1089， -1088； 9s 成交在-1670； 1y 成交在-2275， -2270， 最后收在-2275 附近。

超长期限， 18s 成交在-3210， -3220； 2y 成交在-4060。

Spread 方面， 1w*2w 成交在-41.25； 2w*1s 成交在-102。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-42	7.2749	-1.2
2W	14	-83	7.2708	-2
1M	32	-186	7.2605	2
2M	62	-357	7.2434	0
3M	90	-522	7.2270	-2.5
6M	182	-1090	7.1701	-6
9M	308	-1673	7.1118	-3
1Y	365	-2274	7.0517	-12
18M	547	-3210	6.9581	-10
2Y	732	-4040	6.8751	-70
3Y	1096	-5200	6.7591	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1996	
CLOSING SPOT RATE			7.2791	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-171	-335.5	-904	-1487	-2088
2M		-164.5	-733	-1316	-1917
3M			-568.5	-1151.5	-1752.5
6M				-583	-1184
9M					-601



文 / Edison Zeng

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