



【2024-12-06】

今日 Fixing 定在 7.1848，较上一交易日下调了 31 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅上升。

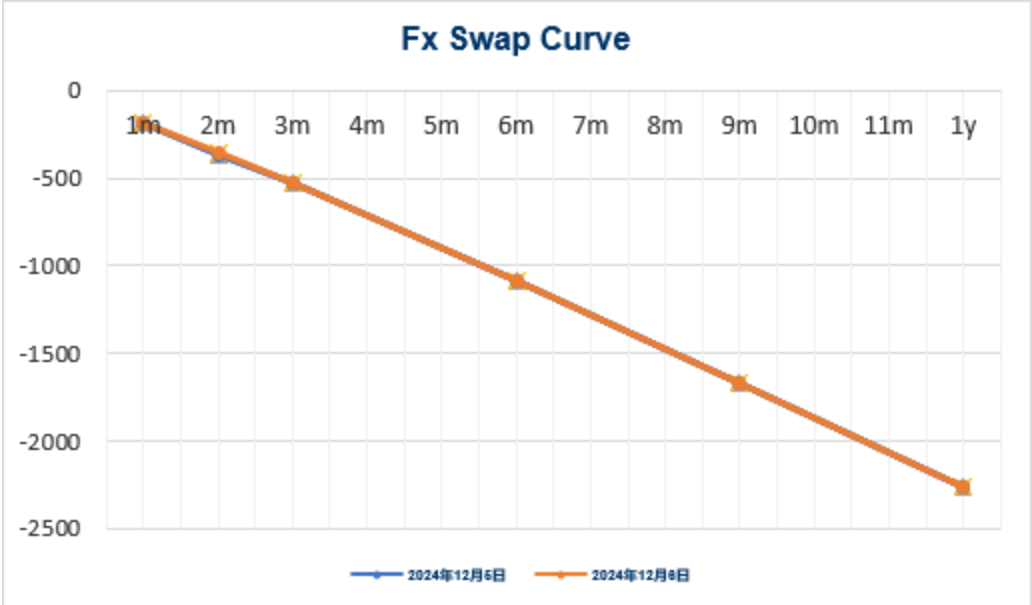
短端，O/N 成交在-18.8~-18.4。T/N 成交在-6.3~-5.98。S/N 成交在-6.27~-6。1w 成交在-43.39~-43。1s 成交在-181.5~-180.5。2s 成交在-361~-359.5。3s 成交在-524~-522.5，尾盘收在-524。

中长期限，6s 成交在-1088~-1078。9s 成交在-1672~-1670。1y 成交在-2263~-2245，尾盘收在-2262。

Spread 上，2*3s 成交在-163。6*9s 成交-586。6*12s 成交在-1173， -1164， -1167。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	7.2539	0.2
2W	14	-85	7.2497	-1
1M	31	-181	7.2401	0.9
2M	62	-361	7.2221	7
3M	90	-523	7.2059	7
6M	182	-1088	7.1494	0
9M	304	-1666	7.0916	1
1Y	365	-2261	7.0321	1
18M	547	-3190	6.9392	0
2Y	730	-3950	6.8632	0
3Y	1095	-5200	6.7382	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1848	
CLOSING SPOT RATE			7.2582	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-180.1	-341.9	-906.9	-1484.9	-2079.9
2M		-161.8	-726.8	-1304.8	-1899.8
3M			-565	-1143	-1738
6M				-578	-1173
9M					-595



文 / Jason Ge

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