



【2024-12-05】

今日 Fixing 定在 7.1879，较上一交易日下降了 55 个 bp。今日各期限收盘价较上一交易日有所上升。

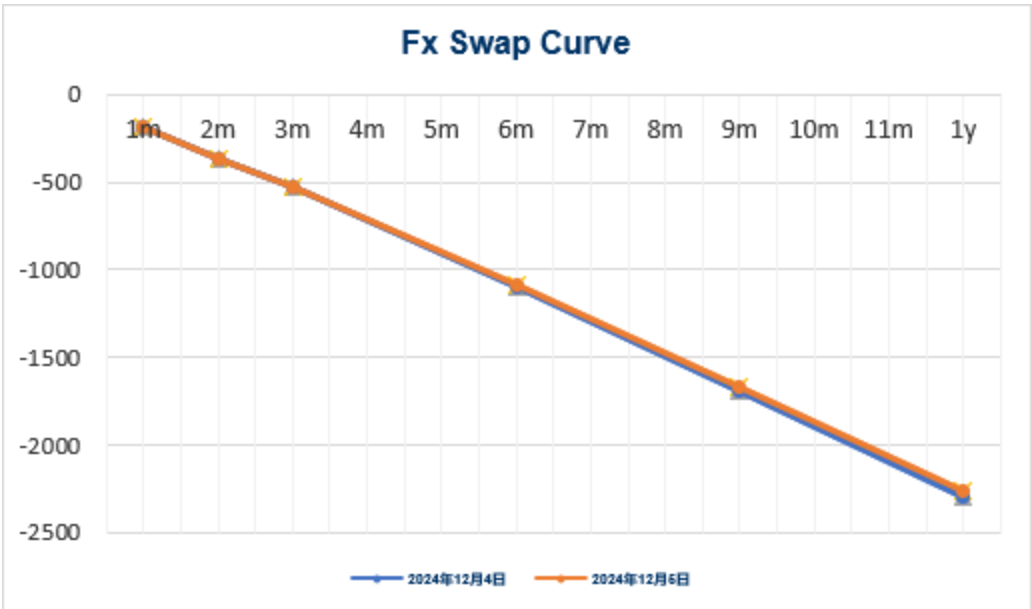
短端，O/N 主要成交在-6.8~-6.1。 T/N 主要成交在-19.58~-18.3 的位置。S/N 主要成交在-6.3~-6.16 的位置。1w 成交在-43.5， -43.7 等位置。2w 成交在-85， -84.5 的位置。3w 成交在-124.5 的位置。1s 成交在-181.5， -182， -182.5， -183， -182 等位置。2s 成交在-367， -369 等位置。3s 成交在-531， -530， -529.5， -530 等位置。

中长期，6s 成交在-1088， -1090， -1087 等位置。9s 成交在-1670， -1668 等位置。1y 成交在-2266， -2267， -2265， -2262， -2260 等位置。
超长期限，18s 成交在-3185 的位置。

Spread 方面，1*2w 成交在-41 的位置。2*3w 成交在-40 的位置。3w*1s 成交在-57.5 的位置。1*2s 成交在-185 的位置。2*3s 成交在-162 的位置。
6*12s 成交在-1178， -1179 的位置

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	7.2566	0.03
2W	14	-85	7.2525	0
1M	31	-182	7.2428	0.8
2M	63	-368	7.2242	-4
3M	91	-530	7.2080	-5
6M	182	-1088	7.1522	7
9M	304	-1667	7.0943	26
1Y	365	-2262	7.0348	32
18M	547	-3190	6.9420	45
2Y	730	-3950	6.8660	80
3Y	1095	-5200	6.7410	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1879	
CLOSING SPOT RATE			7.2610	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-186	-348	-906	-1485	-2080
2M		-162	-720	-1299	-1894
3M			-558	-1137	-1732
6M				-579	-1174
9M					-595



文 / Yiff Wang

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