



【2024-12-02】

今日美元/人民币中间价报 7.1865，较上一个交易日下调 12bp，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

ON 成交在 -6.3~-6；TN 成交在 -5.95~-5.75；SN 成交在 -5.87~-5.78 之间。

1w 成交在 -41.9~-40.8 的位置；3w 成交在 -126，-125 的位置；1S 反复成交在 -188~-186 之间；2s 成交在 -357~-355；3S 成交在 -519，-518.5，-518，-517，-516，-515 附近。

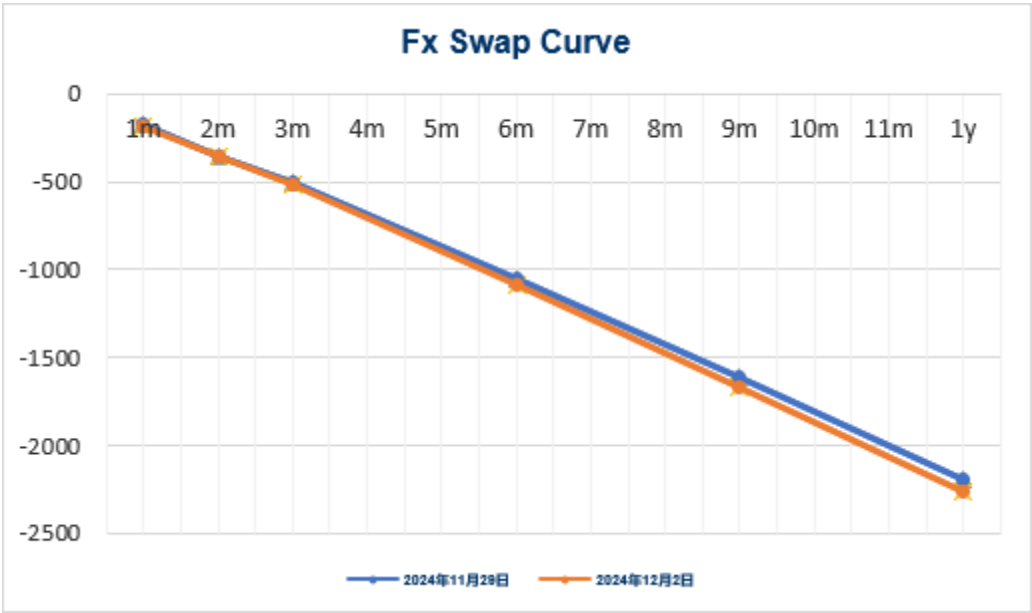
中长期限，6s 成交在 -1084，-1083，-1082，-1080，-1078，-1075，-1070，-1065，尾盘收在 -1084；9S 成交在 -1668，-1667，-1666，-1665，-1660，-1655，-1650，-1645，尾盘给到 -1668 附近；1Y 从 -2225 给到 -2240 附近，午后成交在 -2240，-2241，-2242，-2245，-2250 附近，随后又给到 -2268 附近，尾盘收在 -2266。

Spread 方面，1s*2s 成交在 -170，2s*3s 成交在 -160~-157；3s*6s 成交在 -560；1y*3y 成交在 -2865。

超长期限，18s 成交在 -3200；3y 成交在 -5140。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	7.2665	-0.67
2W	14	-81	7.2625	0
1M	33	-188	7.2518	-17.5
2M	63	-357	7.2349	-1
3M	90	-519	7.2187	-13.5
6M	182	-1084	7.1622	-31
9M	309	-1670	7.1036	-54
1Y	365	-2262	7.0444	-70
18M	547	-3200	6.9506	-120
2Y	730	-3970	6.8736	-100
3Y	1097	-5100	6.7606	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1865	
CLOSING SPOT RATE			7.2706	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-169	-331	-896	-1482	-2074
2M		-162	-727	-1313	-1905
3M			-565	-1151	-1743
6M				-586	-1178
9M					-592



文 / Ray Yan

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