



【2024-12-18】

今日美元/人民币中间价报 7.1880，较上一个交易日下调 11bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

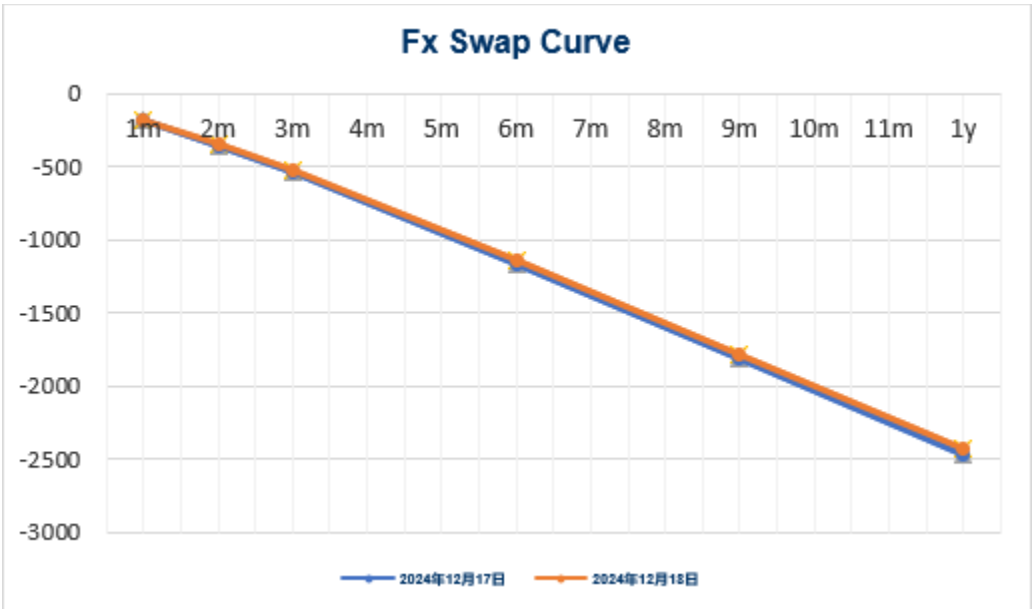
ON 从-5.1 给到-5.2、5.3；TN 早盘在-5.4~-5.25 之间来回成交，午后买回-5.2 附近；SN 从-16.05 给到-16.1、-16.2。1W 成交在-37.7；2W 从-81 买到-80.6。 1S 从-180 买到-177.9；2S 成交在-351 附近；3S 从-525 买到-523、-522。

中长期限，6S 从-1143 买到-1135，后给回-1138，尾盘收在-1135 附近；9S 从-1780 买到-1777，尾盘收在-1785 附近；1Y 从-2440 买到-2435、-2430、-2429，尾盘收在-2430。

Spread 方面，3*6S 成交在-615，6*12S 成交在-1294、-1295、-1285、-1280。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-38	7.2818	1.66
2W	14	-76	7.2780	3
1M	32	-178	7.2678	9.21
2M	62	-352	7.2505	7
3M	90	-525	7.2331	9
6M	182	-1135	7.1721	32
9M	304	-1785	7.1071	29.5
1Y	367	-2426	7.0430	39
18M	549	-3470	6.9386	70
2Y	731	-4400	6.8456	50
3Y	1095	-5785	6.7071	80
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1880	
CLOSING SPOT RATE			7.2856	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-173.7	-347.2	-957.2	-1607.2	-2248.2
2M		-173.5	-783.5	-1433.5	-2074.5
3M			-610	-1260	-1901
6M				-650	-1291
9M					-641



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