



【2024-12-20】

今日 Fixing 定在 7.1901，较上一交易日下调了 10 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅上涨。

短端，O/N 成交在-17.3~-16.9。T/N 成交在-5.6~-5.4。S/N 成交在-11~-10.85。1w 成交在-39~-38.8。2w 成交在-77.5~-77。1s 成交在-174~-173。2s 成交在-355。3s 成交在-531。

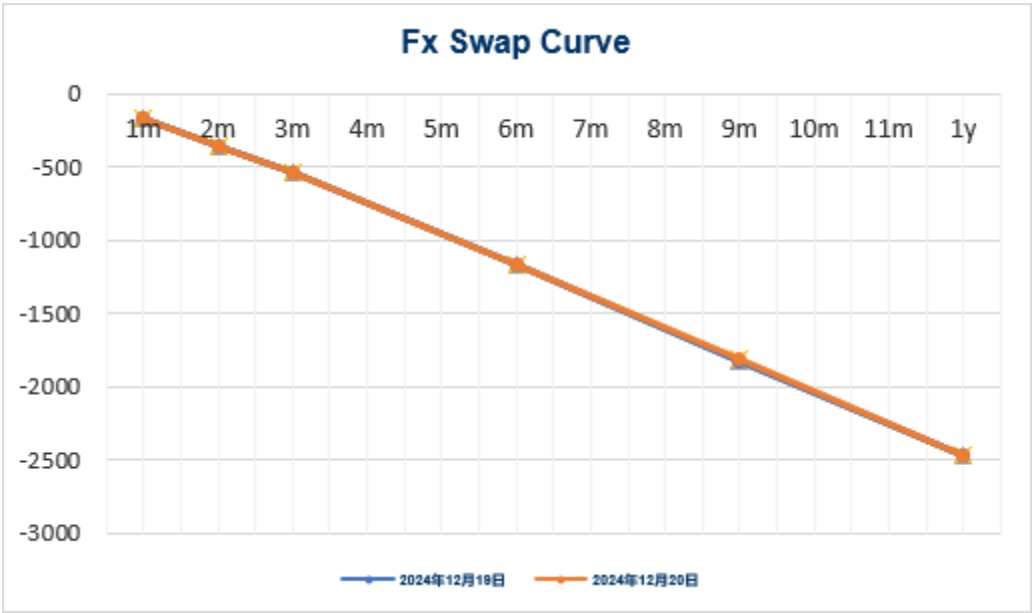
中长期限，6s 成交在-1165~-1156。9s 成交在-1815~-1810。1y 成交在-2473~-2463，尾盘收在-2465。

长期限上，18s 成交-3600，-3590。2y 成交在-4525~-4500。3y 成交在-6010~-5980。

Spread 上，6*12s 成交在-1110~-1105，1*2y 成交在-2051。2y*3y 成交在-1490~-1480。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.2946	-0.19
2W	14	-76	7.2909	1
1M	31	-173	7.2812	0.01
2M	62	-355	7.2630	8
3M	90	-532	7.2453	4.1
6M	182	-1163	7.1822	2
9M	304	-1812	7.1173	8
1Y	365	-2462	7.0523	13
18M	547	-3590	6.9395	10
2Y	730	-4500	6.8485	30
3Y	1095	-5980	6.7005	5
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1901	
CLOSING SPOT RATE			7.2985	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-182.2	-358.8	-989.9	-1638.9	-2288.9
2M		-176.6	-807.7	-1456.7	-2106.7
3M			-631.1	-1280.1	-1930.1
6M				-649	-1299
9M					-650



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