



【2024-12-09】

今日美元/人民币中间价报 7.1870，较上一个交易日上调 22bp，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

ON 成交在 -6.4~-6.15；TN 成交在 -6.25~-6.1；SN 成交在 -6.2~-6.1 之间。

1w 成交在 -43，-42.7 的位置；1S 反复成交在 -193.5~-193 之间；2s 成交在 -360 附近；3S 成交在 -524~-522 附近。

中长期限，6s 成交在 -1085,-1083,-1082,-1080,-1078，-1075 尾盘收在 -1085；9S 成交在 -1665,-1663,-1660,-1655,-1650 尾盘给到 -1668 附近；1Y 从 -2250 买到 -2240 附近，午后成交在 -2248,-2250,-2252,-2255 附近，随后又给到 -2263 附近，尾盘收在 -2262。

Spread 方面，6s*12s 成交在 -1175，-1170，-1165，11s*12s 成交在 -190，-188 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	7.2717	0.44
2W	15	-90	7.2670	-5
1M	33	-193	7.2567	-11.91
2M	62	-360	7.2400	1
3M	90	-524	7.2236	-1.2
6M	182	-1085	7.1675	3
9M	307	-1666	7.1094	0
1Y	365	-2257	7.0503	4
18M	547	-3180	6.9580	10
2Y	730	-4000	6.8760	-50
3Y	1097	-5230	6.7530	-30
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1870	
CLOSING SPOT RATE			7.2760	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-167.19	-331.19	-891.99	-1472.99	-2063.99
2M		-164	-724.8	-1305.8	-1896.8
3M			-560.8	-1141.8	-1732.8
6M				-581	-1172
9M					-591

