



【2024-12-16】

今日美元/人民币中间价报 7.1882，较上一个交易日上调 6bp，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

ON 成交在 -5.6~-5.14；TN 成交在 -5.6~-5.3；SN 成交在 -5.6~-5.3 之间。

1w 成交在 -44 的位置； 1S 反复成交在 -192.5~-192 之间 ； 2s 成交在 -358 附近 ； 3S 成交在 -535~-532 附近； 5S 成交在 -952。

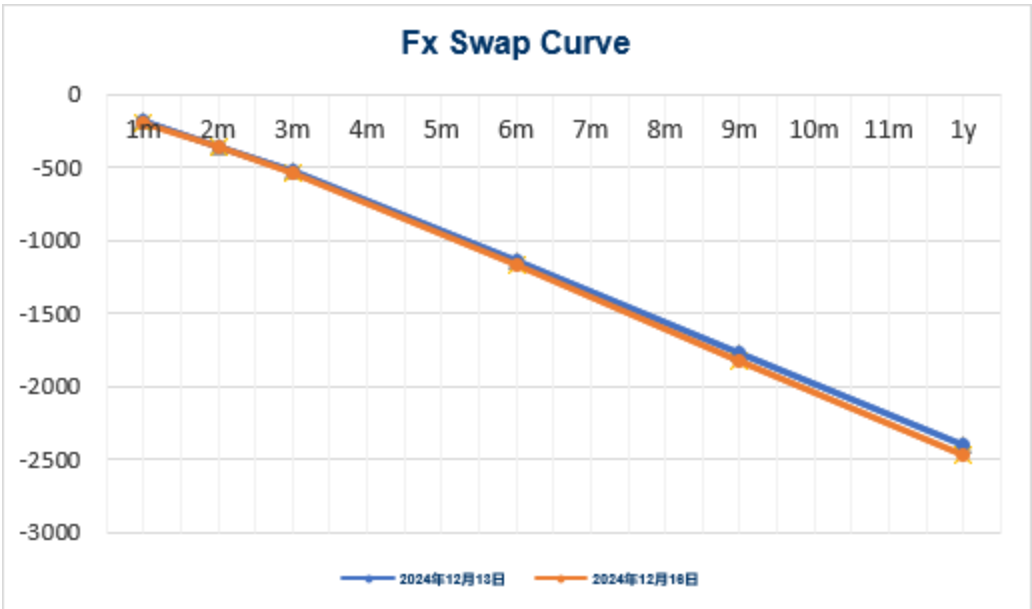
中长期限， 6s 成交在 -1175， -1172， -1171， -1168， -1165， -1155 尾盘收在 -1170 ； 9S 成交在 -1815， -1805， -1790， -1785 尾盘给到 -1819 附近； 1Y 从 -2400 给到 -2470 附近 ， 午后成交在 -2475， -2478， -2480 附近， 随后又买到 -2470 附近， 尾盘收在 -2469 。

超长期限， 18s 成交在 -3550， -3545； 2y 成交在 -4450； 3y 成交在 -5800；

Spread 方面， 2s*5s 成交在 -595； 3s*6s 成交在 -635

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-44	7.2778	-4.95
2W	15	-83	7.2739	-5
1M	34	-192	7.2630	-16.89
2M	62	-358	7.2464	3
3M	90	-535	7.2287	-8
6M	182	-1170	7.1652	-36
9M	306	-1819	7.1003	-51
1Y	365	-2470	7.0352	-69
18M	547	-3545	6.9277	-95
2Y	730	-4460	6.8362	-160
3Y	1097	-5835	6.6987	-185
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1882	
CLOSING SPOT RATE			7.2822	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-165.31	-342.61	-977.61	-1626.61	-2277.61
2M		-177.3	-812.3	-1461.3	-2112.3
3M			-635	-1284	-1935
6M				-649	-1300
9M					-651



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