

收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列



NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2024-12-24】

今日美元/人民币中间价报 7.1876，较上一个交易日上调 6bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 成交在-10.4~-9.5 之间；今日无 TN；SN 在-5.45、-5.44 反复成交。1W 成交在-38.32~-38.25 之间；2W 成交在-76.63~-75 附近。1S 成交在-175；2S 成交在-354~-353.25 之间；3S 成交在-533~-532 之间；4S 成交在-752；5S 成交在-960~-957 之间。

中长期，6S 从-1180 给到-1181、-1186、-1187；9S 成交在-1860~-1825 附近；1Y 从-2490 给到-2494、-2505、-2507、-2517。

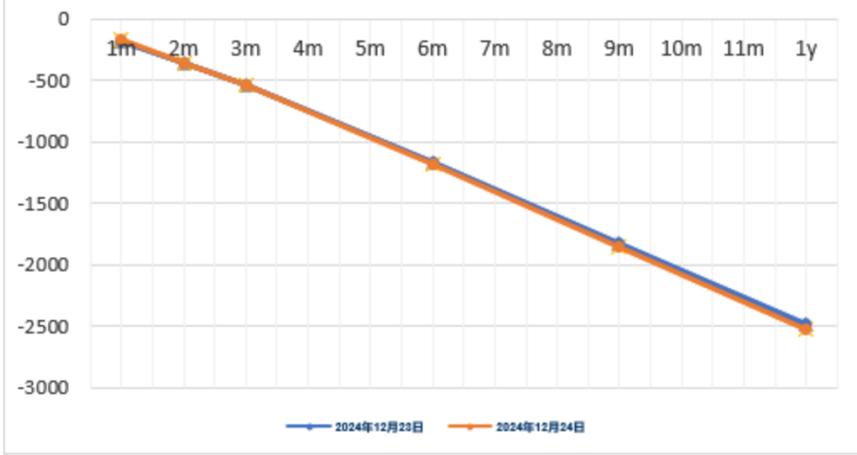
超长期，2Y 成交在-4600。

Spread 方面，1W*2W 成交在-37.5，2*3S 成交在-179，5*6S 成交在-223、-226，6*12S 成交在-1320、-1325。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-38	7.2949	0.58
2W	14	-76	7.2911	2
1M	32	-175	7.2812	1.6
2M	62	-353	7.2634	3
3M	90	-535	7.2452	-2.52
6M	182	-1185	7.1802	-16
9M	305	-1850	7.1137	-30
1Y	365	-2517	7.0470	-39
18M	547	-3635	6.9352	-60
2Y	732	-4590	6.8397	-70
3Y	1096	-6125	6.6862	-140
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1876	
CLOSING SPOT RATE			7.2987	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-178.35	-360.32	-1009.9	-1674.9	-2341.9
2M		-181.97	-831.55	-1496.55	-2163.55
3M			-649.58	-1314.58	-1981.58
6M				-665	-1332
9M					-667

Fx Swap Curve



文 / Cathy He

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