

# 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

## 【2024-12-26】

今日 Fixing 定在 7.1897，较上一交易日上升了 29 个 bp。今日各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 主要成交在-5~-1。T/N 主要成交在-15~-11 的位置。S/N 主要成交在-5.1~-4.6 的位置。1w 成交在-35.2, -35.01, -34.95, -34.8, -34 等位置。2w 成交在-73.8, -73 的位置。1s 成交在-151, -150.5 等位置。2s 成交在-341, -340 等位置。3s 成交在-541, -540 等位置。

中长期，6s 成交在-1195, -1192, -1190 等位置。9s 成交在-1890, -1885 等位置。1y 成交在-2580, -2575, -2570, -2571, -2565 等位置。

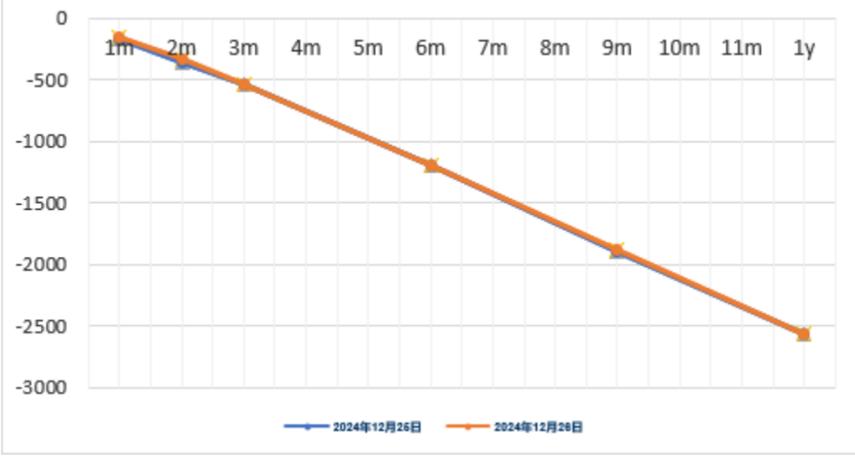
超长期限，18s 成交在-3750 的位置。2y 成交在-4720 的位置。3y 成交在-6350 的位置。

Spread 方面，3\*6s 成交在-650 的位置。4\*5s 成交在-217, -215 的位置。5\*6s 成交在-233 的位置。9\*12s 成交在-680.5 的位置。6\*12s 成交在-1379 的位置。2\*3y 成交在-1640 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-32	7.2957	2.5
2W	14	-70	7.2919	0
1M	28	-151	7.2838	18.1
2M	60	-339	7.2650	15
3M	91	-540	7.2449	-4.9
6M	182	-1190	7.1799	5
9M	304	-1885	7.1104	5
1Y	365	-2567	7.0422	3
18M	547	-3770	6.9219	10
2Y	730	-4755	6.8234	-55
3Y	1095	-6360	6.6629	-10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1897	
CLOSING SPOT RATE			7.2989	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-188.1	-389	-1039.1	-1734.1	-2416.1
2M		-200.9	-851	-1546	-2228
3M			-650.1	-1345.1	-2027.1
6M				-695	-1377
9M					-682

### Fx Swap Curve



文 / Yiff Wang

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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)