



【2024-12-11】

今日美元/人民币中间价报 7.1843，较上一个交易日下调 53bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

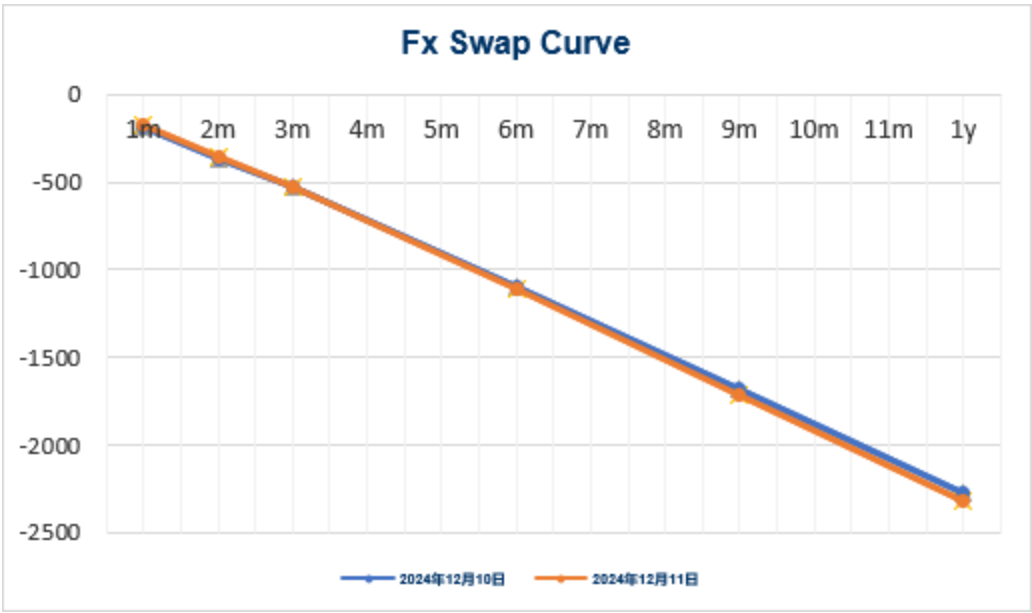
ON 成交在-6.3~-6 附近；TN 早盘从-6 一路买到-5.8，后给回-5.85、-5.86、-5.9，尾盘收在-5.9；SN 从-17.35 一路给到-17.41，尾盘收在-17.39。1W 在-40.46~-40.4 之间来回成交；2W 从-81 买到-80.6；3W 成交在-121.5~-120.8 之间。1S 从-177.5 买到-177，后给到-178；2S 成交在-360~-356.5 附近；3S 成交在-524~-522 之间。

中长期限，6S 成交在-1106，尾盘收在-1115 附近；9S 从-1695 给到-1700，尾盘收在-1718 附近；1Y 从 2298 给到-2305、-2310、-2320、-2330。

Spread 方面，1W*2W 成交在-40，2W*3W 成交在-40.1、-40.15，2W*1S 成交在-81，3W*1S 成交在-55.5，5*6S 成交在-196，9*12S 成交在-597、-603、-605、-607。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.2550	2.45
2W	14	-81	7.2509	4
1M	31	-178	7.2412	10.5
2M	62	-358	7.2233	8
3M	90	-523	7.2067	6
6M	182	-1115	7.1475	-15
9M	305	-1719	7.0871	-39
1Y	367	-2325	7.0265	-51
18M	549	-3250	6.9340	-35
2Y	731	-4090	6.8500	-140
3Y	1095	-5340	6.7250	-90
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1843	
CLOSING SPOT RATE			7.2590	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-179.6	-345.1	-937.1	-1541.1	-2147.1
2M		-165.5	-757.5	-1361.5	-1967.5
3M			-592	-1196	-1802
6M				-604	-1210
9M					-606



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