



【2024-12-25】

今日美元/人民币中间价报 7.1868，较上一个交易日下调 8bp，全天掉期市场交投活跃。

T/N 成交在-4.92~-4； S/N 成交在-15.25~-15.23； 1s 成交在-183, -170； 2s 成交在-353, -352, -351。

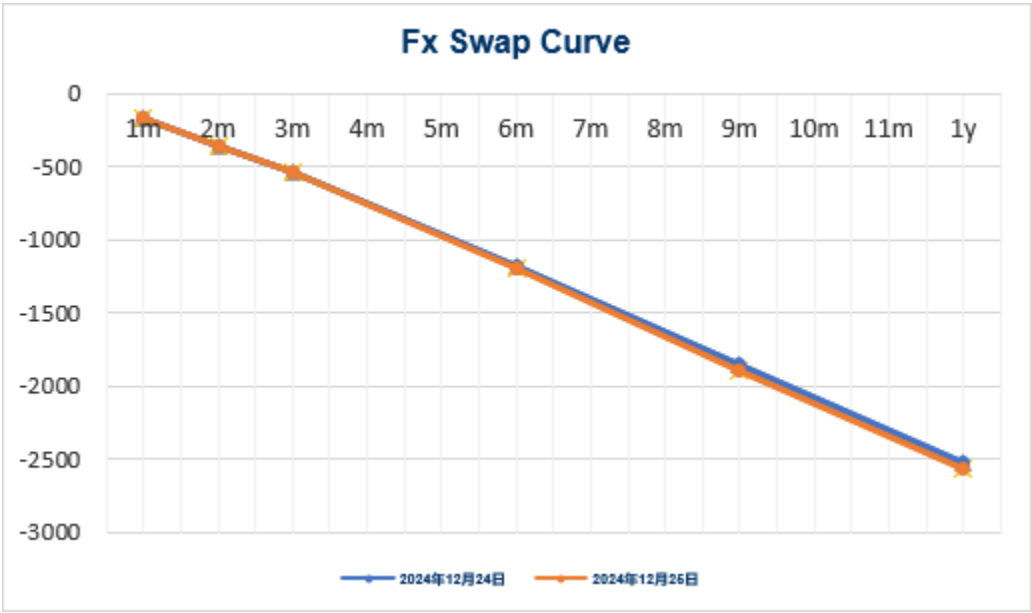
中长期限，6s 成交在-1185, -1190, -1187； 1y 成交在-2544, -2537, -2533, 后面又给到-2547, -2550, -2560 最后收在-2573 附近。

超长期限， 无。

Spread 方面， 4s*5s 成交在-203, -202, -200； 5s*6s 成交在-234, -230； 4s*5s*6s 成交在+32, +30, +28； 6s*1y 成交在-1370。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-35	7.2955	3.5
2W	14	-70	7.2919	6
1M	31	-169	7.2820	6.1
2M	62	-354	7.2636	0
3M	90	-535	7.2454	0.42
6M	182	-1195	7.1794	-10
9M	304	-1890	7.1099	-40
1Y	367	-2570	7.0419	-53
18M	549	-3780	6.9209	-145
2Y	731	-4700	6.8289	-110
3Y	1095	-6350	6.6639	-225
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1868	
CLOSING SPOT RATE			7.2989	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-184.5	-366	-1026	-1721	-2401
2M		-181.5	-841.5	-1536.5	-2216.5
3M			-660	-1355	-2035
6M				-695	-1375
9M					-680



文 / Edison Zeng

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