



【2024-12-30】

今日美元/人民币中间价报 7.1889，较上一个交易日下调 4bp，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

ON 成交在-6.4~-5.2；TN 成交在-9.5~-7.55；SN 成交在 -5.45~-5.15 之间。

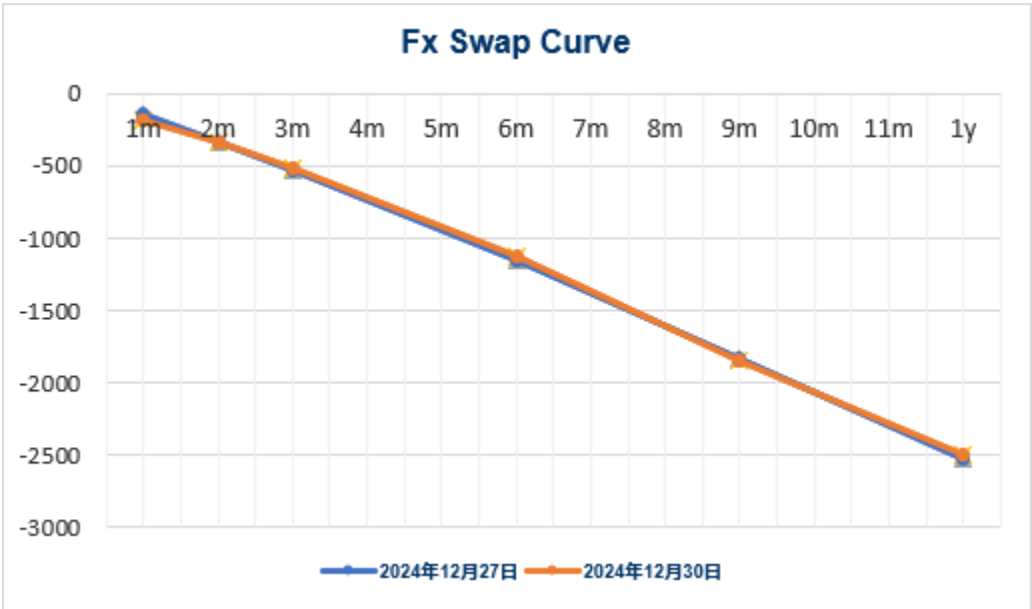
1w 成交在 -38.5，-38.4，-38.1，-38 的位置；2w 成交在-75.5 的位置； 1S 反复成交在 -183~-180 之间 ；2s 成交在-338，-336，-330 附近 ；3s 成交在 -528，-527，-525，-521，520 附近；5s 成交在-950，-948 的位置。

中长期限，6s 成交在-1145， -1144， -1143， -1142， -1141， -1130， -1128 尾盘收在 -1128；9S 成交在-1865， -1860， -1858， -1855， -1850， -1848 尾盘收在-1848 附近；1Y 从 -2508 给到 -2518 附近 ， 午后成交在 -2525， -2521， -2518， -2515， -2505 附近， 尾盘收在 -2502 。

Spread 方面，2w*1s 成交在-108~-106；5s*9s 成交在-910；6s*9s 成交在-720，9s*1y 成交在-655。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-38	7.2954	-3
2W	14	-76	7.2917	-3
1M	34	-179	7.2813	-33.6
2M	60	-330	7.2662	0
3M	90	-518	7.2474	10.8
6M	181	-1126	7.1866	28
9M	280	-1846	7.1146	-13
1Y	368	-2501	7.0491	21
18M	546	-3650	6.9342	48
2Y	732	-4635	6.8357	55
3Y	1097	-6150	6.6842	150
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1889	
CLOSING SPOT RATE			7.2992	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-151.4	-339.4	-947.4	-1667.4	-2322.4
2M		-188	-796	-1516	-2171
3M			-608	-1328	-1983
6M				-720	-1375
9M					-655



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