常规报告系列

# 收盘日评
# 银行间外汇衍生品市场

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

【2024-12-23】

今日美元/人民币中间价报 7.1870，较上一个交易日下调 31bp，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

ON 成交在-5.3~-5.2；TN 成交在-10.8~-10.64；SN 成交在 -5.5~-5.4 之间。

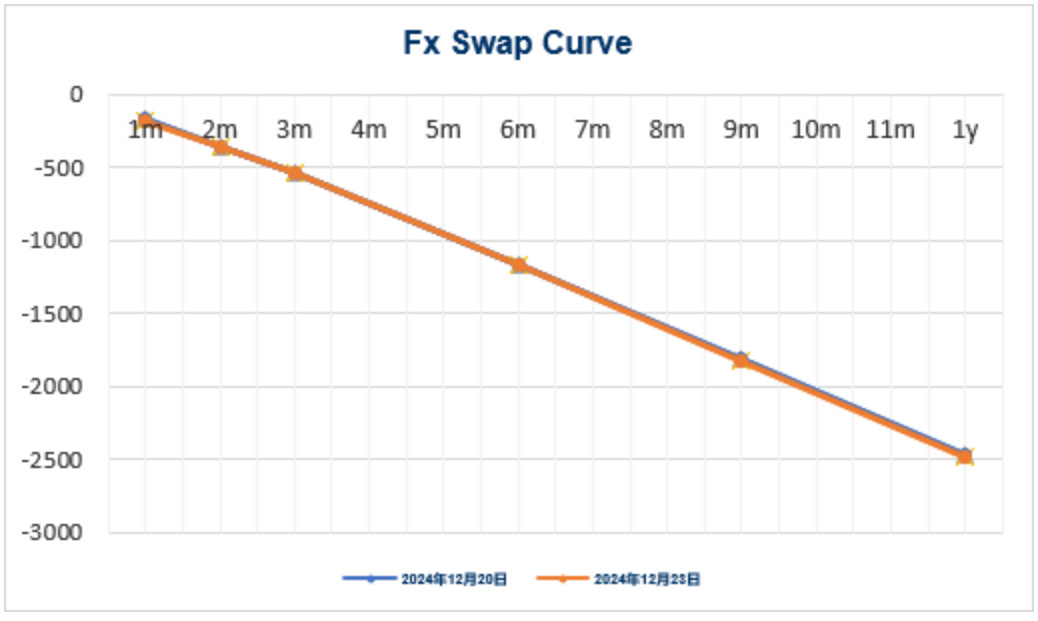
1w 成交在 -38.6,-38.5,-38.4 的位置；2w 成交在-77.5 的位置； 1S 反复成交在 -176.9~-176.5 之间 ； 2s 成交在-356 附近 ； 3S 成交在 -532 附近。

中长期限， 6s 成交在-1169， -1167， -1165 尾盘收在 -1169 ； 9S 成交在-1818，-1817 尾盘给到-1820 附近；1Y 从 -2455 给到 -2463 附近 ，午后成交在 -2469，-2470，-2475，-2478，-2479， 附近，尾盘收在 -2478 。

Spread 方面，6s*1y 成交在-1310。

| Tenor | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|---|---|---|---|---|
| 1W | 7 | -39 | 7.2949 | 0.42 |
| 2W | 14 | -78 | 7.2910 | -2 |
| 1M | 32 | -177 | 7.2811 | -3.6 |
| 2M | 62 | -356 | 7.2632 | -1 |
| 3M | 90 | -533 | 7.2455 | -1 |
| 6M | 182 | -1169 | 7.1819 | -6 |
| 9M | 305 | -1820 | 7.1168 | -8 |
| 1Y | 365 | -2478 | 7.0510 | -16 |
| 18M | 547 | -3575 | 6.9413 | 15 |
| 2Y | 732 | -4520 | 6.8468 | -20 |
| 3Y | 1096 | -5985 | 6.7003 | -5 |
| CNY CENTRAL PARITY RATE | | | 7.1870 | |
| CLOSING SPOT RATE | | | 7.2988 | |

| USD/CNY Spread Ref. | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 2M | 3M | 6M | 9M | 1Y |
| 1M | -179.3 | -356.2 | -992.3 | -1643.3 | -2301.3 |
| 2M | | -176.9 | -813 | -1464 | -2122 |
| 3M | | | -636.1 | -1287.1 | -1945.1 |
| 6M | | | | -651 | -1309 |
| 9M | | | | | -658 |


Fx Swap Curve
0
-500
-1000
-1500
-2000
-2500
-3000
1m
2m
3m
4m
5m
6m
7m
8m
9m
10m
11m
1y
2024年12月20日
2024年12月23日