



【2024-12-10】

今日美元/人民币中间价报 7.1896，较上一个交易日上调 26bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-6.3~-6.1； T/N 成交在-6.31~-6.18； S/N 成交在-6.23~-6.18； 1w 成交在-43.2， -43； 2w 成交在-84.2； 1s 成交在-188.4， -188.1， -187.9。

中长期限， 6s 成交在-1083， -1086， -1090， -1092； 9s 成交在-1680， -1665， -1653.5； 1y 成交在-2245， -2248， -2255， -2258， -2260， -2272 最后收在-2275 附近。

超长期限， 3y 成交在-5240。

Spread 方面， 5s*6s 成交在-193， 6s*1y 成交在-1168； 2y*3y 成交在-1290。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	7.2450	0.07
2W	14	-84	7.2409	6
1M	32	-188	7.2305	4.61
2M	62	-365	7.2128	-5
3M	90	-529	7.1964	-4.8
6M	182	-1100	7.1393	-15
9M	306	-1680	7.0813	-14
1Y	365	-2274	7.0219	-17
18M	547	-3215	6.9278	-35
2Y	732	-3950	6.8543	50
3Y	1096	-5250	6.7243	-20
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1896	
CLOSING SPOT RATE			7.2493	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-176.6	-340.6	-911.6	-1491.6	-2085.6
2M		-164	-735	-1315	-1909
3M			-571	-1151	-1745
6M				-580	-1174
9M					-594

