



【2024-12-27】

今日 Fixing 定在 7.1893，较上一交易日下调了 4 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上涨。

短端，O/N 成交在-11~-3。T/N 成交在-4.6~-3.2。S/N 成交在-9.5~-8。1w 成交在-37~-32。2w 成交在-73。1s 成交在-145~-141。3s 成交在-532~-529。

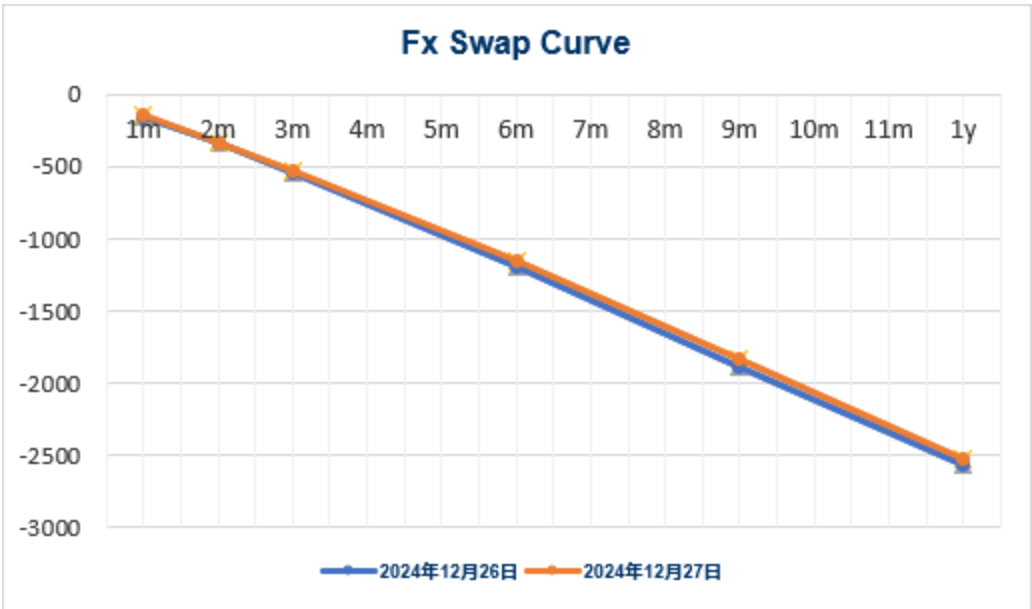
中长期限，6s 成交在-1169~-1155。9s 成交在-1860~-1840。1y 成交在-2545~-2525，尾盘收在-2520。

长期限上，18s 成交-3700。2y 成交在-4700。3y 成交在-6310 -6300。

Spread 上，9*12s 成交在-689。6*12s 成交在-1380~1375。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-35	7.2957	-3
2W	14	-73	7.2919	-3
1M	27	-145	7.2847	5.9
2M	59	-330	7.2662	9
3M	90	-529	7.2463	11.1
6M	181	-1154	7.1838	36
9M	273	-1833	7.1159	52
1Y	365	-2522	7.0470	45
18M	546	-3698	6.9294	72
2Y	730	-4690	6.8302	65
3Y	1095	-6300	6.6692	60
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1893	
CLOSING SPOT RATE			7.2992	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-185	-383.8	-1009	-1688	-2377
2M		-198.8	-824	-1503	-2192
3M			-625.2	-1304.2	-1993.2
6M				-679	-1368
9M					-689



文 / Jason Ge

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