



【2024-12-31】

今日美元/人民币中间价报 7.1884，较上一个交易日下调 5bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-7.95~-6.8；T/N 成交在-5~-3.15；S/N 成交在-16~-14.1。

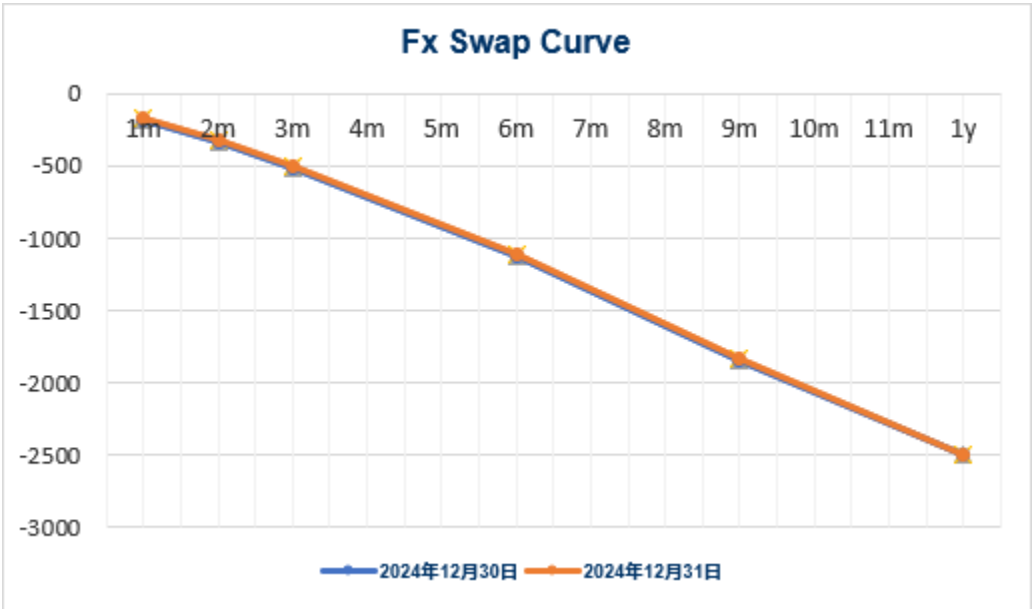
1w 成交在-35.1~-35；2w 成交在-73；1s 成交在-171~-168.5；2s 成交在-323~-318；3s 成交在-504；4s 成交在-720；5s 成交在-908，-905，-900。

中长期限，6s 成交在-1120，-1115，-1111；9s 成交在-1840，-1835，-1830，-1821；1Y 成交在-2482，-2490，-2510，-2506 最后收在-2505 附近。

Spread 方面，1s*2s 成交在-148；5s*6s 成交在-210；6s*9s 成交在-722，-720；6s*1y 成交在-1380；9s*1y 成交在-661，-660，-656。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-35	7.2953	3.04
2W	14	-72	7.2916	4
1M	33	-169	7.2819	10
2M	59	-318	7.2670	12
3M	90	-503	7.2485	15
6M	181	-1111	7.1877	15
9M	279	-1826	7.1162	20
1Y	367	-2498	7.0490	3
18M	546	-3640	6.9348	10
2Y	731	-4620	6.8368	15
3Y	1096	-6200	6.6788	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1884	
CLOSING SPOT RATE			7.2988	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-149.4	-334.4	-942.4	-1657.4	-2329.4
2M		-185	-793	-1508	-2180
3M			-608	-1323	-1995
6M				-715	-1387
9M					-672



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