



【2024-12-17】

今日美元/人民币中间价报 7.1891，较上一个交易日上调 9bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-5.85~-5.6； T/N 成交在-5.7~-5.41； S/N 成交在-5.7~-5.55； 1w 成交在-40； 2w 成交在-80， -79； 3w 成交在-120.5， -120； 1s 成交在-190.5， -187.4； 3s 成交在-535.5， -535。

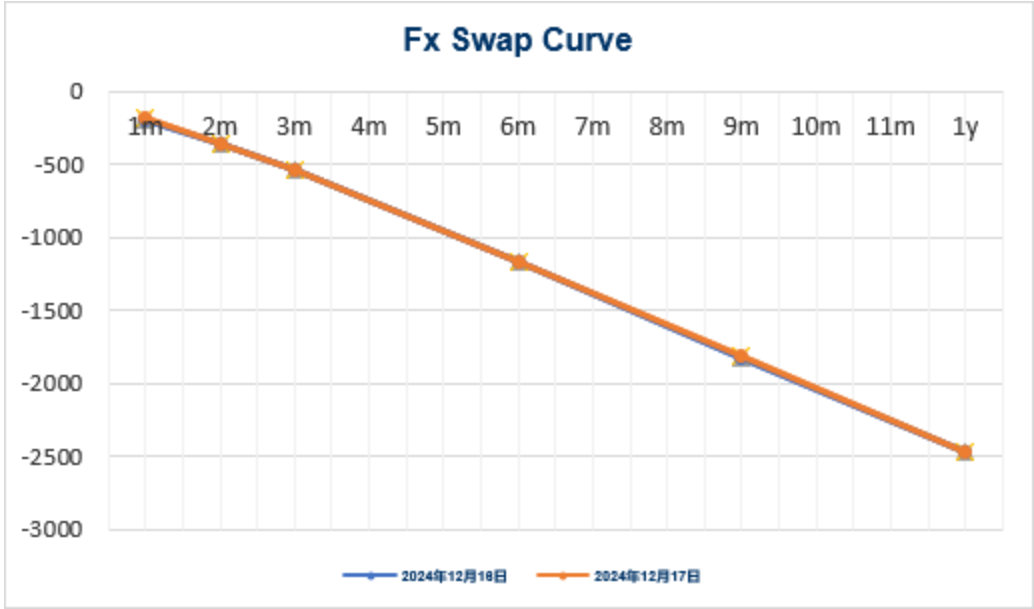
中长期限， 6s 成交在-1172； 9s 成交在-1821， -1815； 1y 成交在-2485， -2480， -2475， -2474， -2468， 最后收在-2387 附近。

超长期限， 18s 成交在-3545， -3540； 2y 成交在-4440； 3y 成交在-5830。

Spread 方面， 2y*3y 成交在-1390， -1400， -1410。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.2800	4.54
2W	14	-80	7.2760	3
1M	33	-187	7.2653	5.38
2M	62	-358	7.2482	0
3M	90	-534	7.2306	1
6M	183	-1167	7.1674	4
9M	305	-1815	7.1026	4.5
1Y	365	-2465	7.0375	5
18M	550	-3540	6.9300	5
2Y	732	-4450	6.8390	10
3Y	1096	-5865	6.6975	-30
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1891	
CLOSING SPOT RATE			7.2840	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-170.99	-346.99	-979.49	-1627.49	-2277.99
2M		-176	-808.5	-1456.5	-2107
3M			-632.5	-1280.5	-1931
6M				-648	-1298.5
9M					-650.5



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