

收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列



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

【2024-12-19】

今日 Fixing 定在 7.1911，较上一交易日上升了 31 个 bp。今日各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 主要成交在-6~-5.2。T/N 主要成交在-16.6~-16.2 的位置。S/N 主要成交在-5.58~-5.4 的位置。1w 成交在-38.8, -38.9, -38.83 等位置。2w 成交在-77.25, -77.35 的位置。3w 成交在-117 的位置。1s 成交在-173.5, -173, -175 等位置。2s 成交在-364, -364.5, -362, -361 等位置。3s 成交在-535, -537, -536.7, -538 等位置。

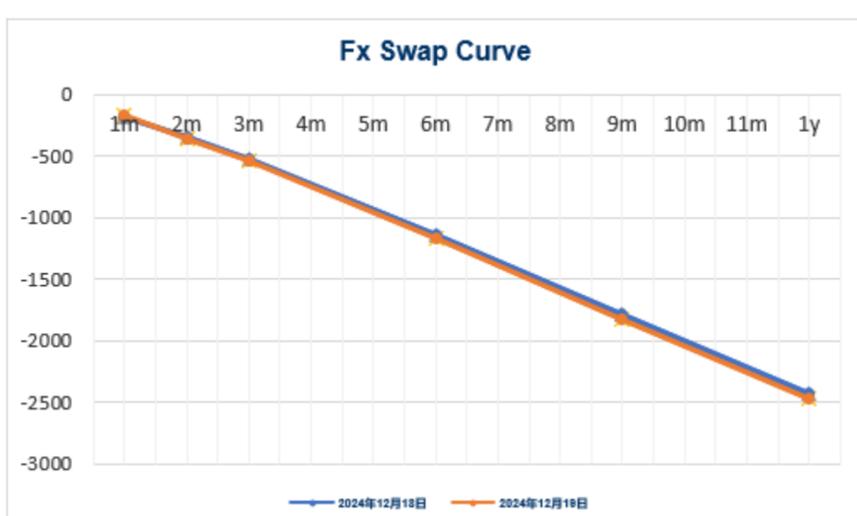
中长期，6s 成交在-1175, -1170, -1168 等位置。9s 成交在-1833, -1825 等位置。1y 成交在-2520, -2510, -2500, -2498, -2495, -2490, -2485, -2475 等位置。

超长期，2y 成交在-4540, -4530 的位置。

Spread 方面，1*2w 成交在-38.5 的位置。1*2s 成交在-190.5 的位置。9*12s 成交在-660 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.2953	-0.96
2W	14	-77	7.2915	-1
1M	31	-173	7.2819	4.69
2M	63	-363	7.2629	-12
3M	91	-536	7.2456	-11
6M	182	-1165	7.1827	-30
9M	304	-1820	7.1172	-35
1Y	366	-2475	7.0517	-49
18M	547	-3600	6.9392	-130
2Y	730	-4530	6.8462	-130
3Y	1095	-5985	6.7007	-200
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1911	
CLOSING SPOT RATE			7.2992	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-189.89	-362.89	-991.89	-1646.89	-2301.89
2M		-173	-802	-1457	-2112
3M			-629	-1284	-1939
6M				-655	-1310
9M					-655



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