



【2024-10-24】

今日 Fixing 定在 7.1286，较上一交易日上升了 41 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所上升。

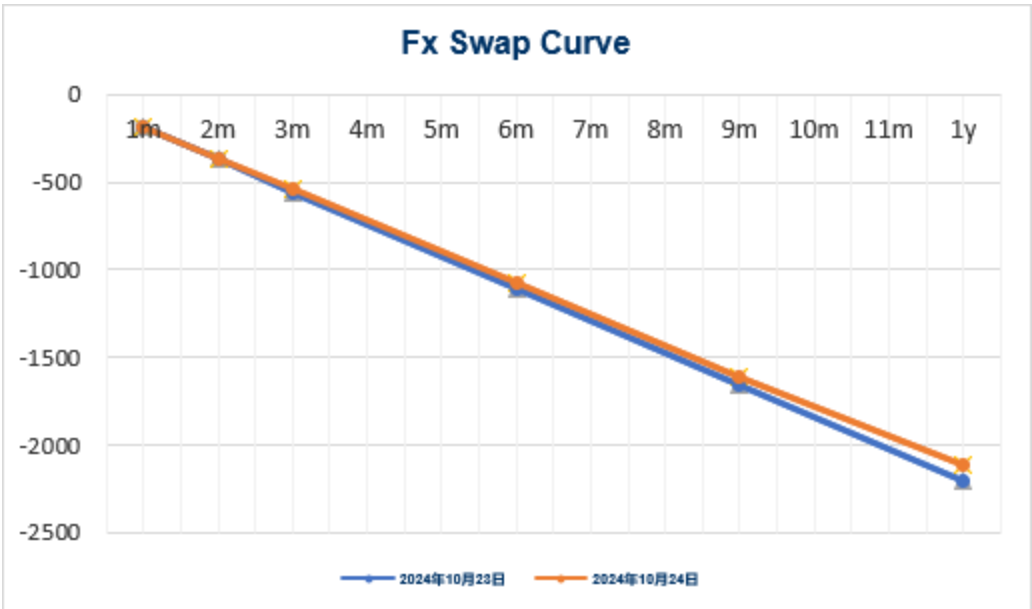
短端，O/N 主要成交在-6.4~-5.7。T/N 主要成交在-17.9~-17.6 的位置。S/N 主要成交在-6~-5.5 的位置。1w 成交在-41.5 的位置。2w 成交在-89 的位置。3w 成交在-125 的位置。1s 成交在-191，-191.5，-190.5，-190，-189 等位置。2s 成交在-377.5，-376.5，-376，-375 的位置。3s 成交在-550，-548，-547，-545，-542，-540，-537 等位置。

中长期限，6s 成交在-1115，-1110，-1109，-1095，-1083，-1075 等位置。9s 成交在-1650，-1640，-1637，-1628，-1620，-1615，-1610 等位置。1y 成交在-2220，-2217，-2215，-2212，-2200，-2190，-2180，-2150，-2120，-2115 等位置。

Spread 方面，2*3s 成交在-170，-169 的位置。1*3s 成交在-358，-355 的位置。6*9s 成交在-540 的位置。9*12s 成交在-540，-505 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.1093	1.97
2W	15	-88	7.1045	-1
1M	32	-187	7.0946	1.35
2M	63	-373	7.0760	1
3M	91	-541	7.0592	25
6M	182	-1081	7.0053	25
9M	273	-1615	6.9518	41
1Y	365	-2115	6.9018	89
18M	547	-2900	6.8233	180
2Y	730	-3500	6.7633	200
3Y	1095	-4400	6.6733	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1286	
CLOSING SPOT RATE			7.1133	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-186	-354	-893.5	-1428	-1928
2M		-168	-707.5	-1242	-1742
3M			-539.5	-1074	-1574
6M				-534.5	-1034.5
9M					-500



文 / Yiff Wang

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