



【2024-11-01】

今日 Fixing 定在 7.1135，较上一交易日下调了 115 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅下跌。

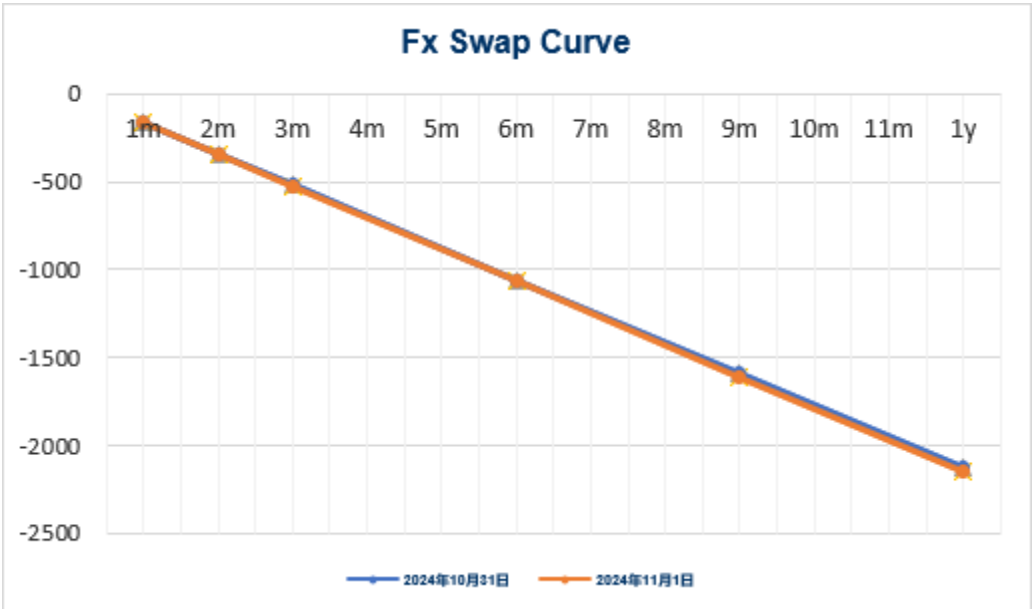
短端，O/N 成交在-18.3~-17.8。T/N 成交在-5.8~-5.7。S/N 成交在-5.83~-5.77。1w 成交在-40.7~-40.5。2w 成交在-80~-79.7。3w 成交在-118~-117.5。1s 成交在-165.6~-165。2s 成交在-345~-344。3s 成交在-523~-519，尾盘收在-522。5s 成交在-893。

中长期限，6s 成交在-1071~-1063。9s 成交在-1607~-1595。1y 成交在-2152~-2130，尾盘收在-2151。

Spread 上，2w*3w 成交在-37.7。3*6s 成交在-548~-546。9*12s 成交在-543。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.1210	5.11
2W	14	-80	7.1170	0
1M	30	-166	7.1084	-3.2
2M	62	-344	7.0906	0
3M	92	-523	7.0727	-7.8
6M	182	-1068	7.0182	-3
9M	273	-1607	6.9643	-12
1Y	365	-2151	6.9099	-20
18M	546	-2990	6.8260	-10
2Y	730	-3650	6.7600	-45
3Y	1095	-4625	6.6625	-45
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1135	
CLOSING SPOT RATE			7.1250	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-178.4	-357.1	-902.3	-1441.3	-1985.3
2M		-178.7	-723.9	-1262.9	-1806.9
3M			-545.2	-1084.2	-1628.2
6M				-539	-1083
9M					-544



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