



【2024-10-08】

今日美元/人民币中间价报 7.0709，较上一个交易日下调 635 个 bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-6.55， -6， -5.6， -3.5； T/N 成交在-7.3~-5.16； S/N 成交在-6.9~-6.5； 1w 成交在-47， -46.5， -45.1； 1s 成交在-210， -207； 3s 成交在-553。

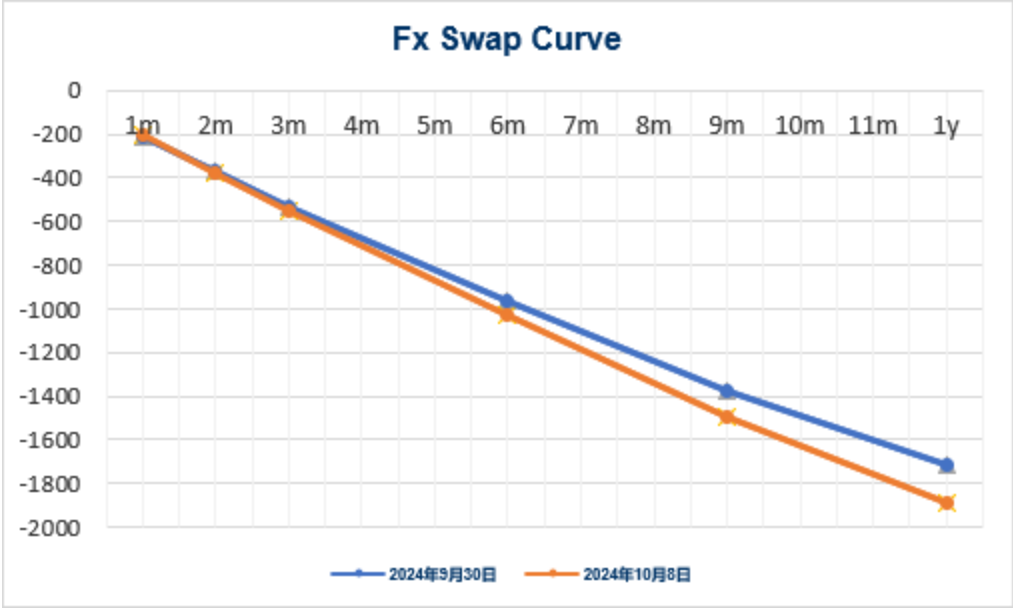
中长期限， 6s 成交在-1037， -1030； 9s 成交在-1493； 1y 成交在-1875， 又给到-1905， 后面又买到-1870， 最后收在-1890 附近。

超长期限， 3y 成在-3650。

Spread 方面， 6s\*9s 成交在-461。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 7    | -43        | 7.0492       | 3          |
| 2W                      | 14   | -88        | 7.0447       | 2          |
| 1M                      | 33   | -209       | 7.0327       | 1.5        |
| 2M                      | 61   | -374       | 7.0161       | -8         |
| 3M                      | 92   | -548       | 6.9987       | -18        |
| 6M                      | 182  | -1030      | 6.9505       | -66        |
| 9M                      | 273  | -1494      | 6.9041       | -118       |
| 1Y                      | 365  | -1885      | 6.8650       | -170       |
| 18M                     | 547  | -2465      | 6.8070       | -280       |
| 2Y                      | 733  | -2865      | 6.7670       | -315       |
| 3Y                      | 1097 | -3500      | 6.7035       | -310       |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 7.0709       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 7.0535       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |        |        |        |         |         |
|---------------------|--------|--------|--------|---------|---------|
|                     | 2M     | 3M     | 6M     | 9M      | 1Y      |
| 1M                  | -165.5 | -339.5 | -821.5 | -1285.5 | -1676.5 |
| 2M                  |        | -174   | -656   | -1120   | -1511   |
| 3M                  |        |        | -482   | -946    | -1337   |
| 6M                  |        |        |        | -464    | -855    |
| 9M                  |        |        |        |         | -391    |



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