



【2024-11-22】

今日 Fixing 定在 7.1942，较上一交易日上调了 8 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-17.5~-17。T/N 成交在-5.6~-5.5。S/N 成交在-5.65~-5.5。1w 成交在-39.15~-38.9。2w 成交在-78。1s 成交在-171~-169。2s 成交在-355~-354。3s 成交在-534~-530，尾盘收在-530。4s 成交在-705。5s 成交在-910~-900。

中长期限，6s 成交在-1095~-1080。9s 成交在-1689~-1675。1y 成交在-2290~-2265，尾盘收在-2265。

Spread 上，1*2s 成交在-184.3。

超长期限，2y 成交在-4010~-4000。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.2413	1.51
2W	14	-79	7.2373	2
1M	30	-169	7.2283	11.4
2M	62	-351	7.2101	12
3M	92	-529	7.1924	5.5
6M	182	-1078	7.1374	20
9M	304	-1666	7.0786	1.5
1Y	365	-2251	7.0201	12
18M	546	-3180	6.9272	10
2Y	731	-4000	6.8452	-20
3Y	1095	-5220	6.7232	-30
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1942	
CLOSING SPOT RATE			7.2452	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-182.6	-359.9	-909.4	-1497.4	-2082.4
2M		-177.3	-726.8	-1314.8	-1899.8
3M			-549.5	-1137.5	-1722.5
6M				-588	-1173
9M					-585

