



【2024-11-15】

今日 Fixing 定在 7.1992，较上一交易日上调了 26 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上升。

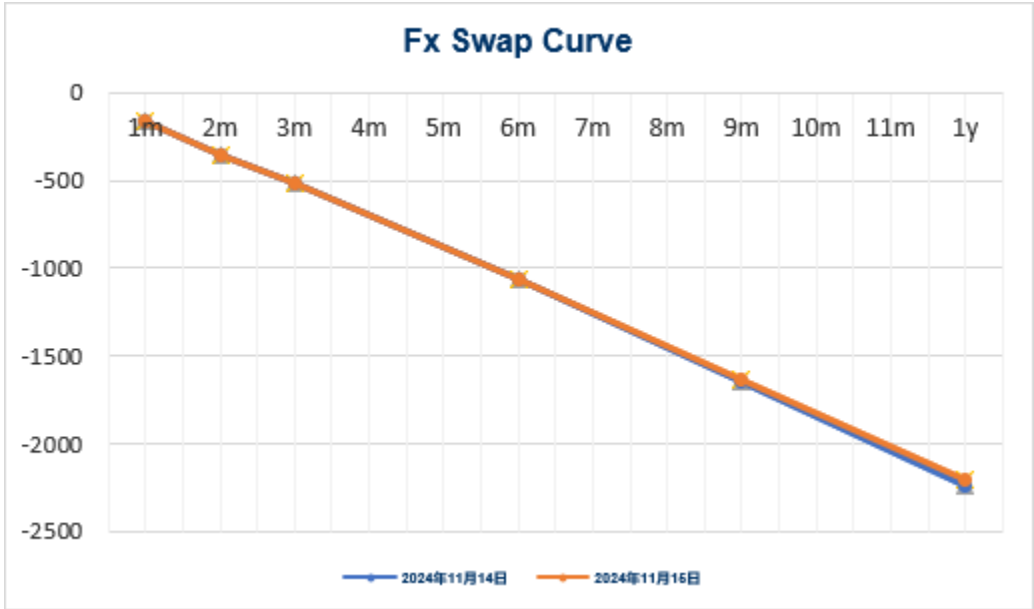
短端，O/N 成交在-17.5~-16.2。T/N 成交在-5.65~-5.5。S/N 成交在-5.65~-5.55。1w 成交在-39.1~-38.9。2w 成交在-77。1s 成交在-167.1~-166.3。2s 成交在-353~-352。3s 成交在-523~-519，尾盘收在-522。

中长期，6s 成交在-1075~-1060。9s 成交在-1660~-1630。1y 成交在-2240~-2195，尾盘收在-2195。

超长期限，18s 成交-3140~-3120。2y 成交在-3920~-3880。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.2271	0.38
2W	14	-77	7.2233	0
1M	30	-167	7.2143	-1
2M	63	-353	7.1957	5
3M	92	-521	7.1789	1
6M	181	-1065	7.1245	5
9M	273	-1633	7.0677	14
1Y	365	-2200	7.0110	35
18M	546	-3125	6.9185	45
2Y	730	-3880	6.8430	70
3Y	1095	-5015	6.7295	85
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1992	
CLOSING SPOT RATE			7.2310	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-186	-354	-898	-1466	-2033
2M		-168	-712	-1280	-1847
3M			-544	-1112	-1679
6M				-568	-1135
9M					-567



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