



【2024-10-17】

今日 Fixing 定在 7.1220，较上一交易日上升了 29 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 主要成交在-6.6~-6.2。 T/N 主要成交在-18.95~-18.79 的位置。S/N 主要成交在-6.4~-6.2 的位置。1w 成交在-43.72， -43.7， -43.65 的位置。2w 成交在-86 的位置。3w 成交在-134 的位置。1s 成交在-184， -185 等位置。2s 成交在-367， -366 的位置。3s 成交在-524， -523.5， -524.5， -525 等位置。4s 成交在-695 的位置。

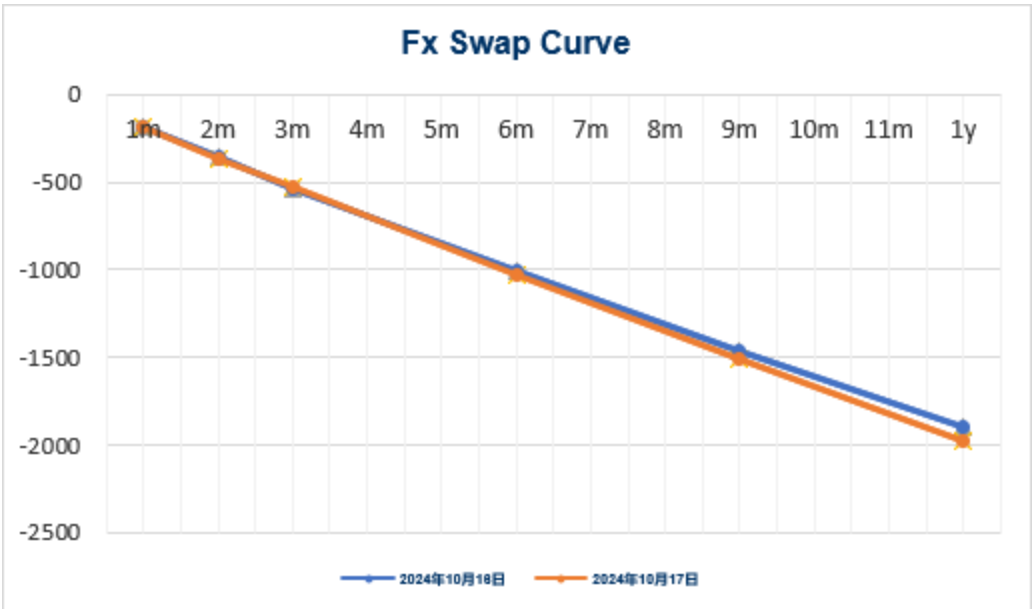
中长期限，6s 成交在-995， -1000， -1005， -1007， -1008， -1010， -1012， -1015， -1018， -1020， -1025 等位置。9s 成交在-1470， -1475， -1490， -1491， -1495， -1510 等位置。1y 成交在-1900， -1910， -1925， -1938， -1945， -1947， -1949， -1960， -1959， -1958， -1965 等位置。

超长期限， 2y 成交在-3050， -3100 的位置。

Spread 方面，1*2s 成交在-181 的位置。3*6s 成交在-485 的位置。9*12s 成交在-454 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-44	7.1189	-1
2W	14	-86	7.1147	-1
1M	33	-186	7.1047	-3
2M	61	-369	7.0864	-14
3M	92	-526	7.0707	10.6
6M	182	-1028	7.0205	-26
9M	273	-1515	6.9718	-50
1Y	365	-1974	6.9259	-73
18M	547	-2640	6.8593	-315
2Y	730	-3050	6.8183	-150
3Y	1097	-3885	6.7348	-185
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1220	
CLOSING SPOT RATE			7.1233	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-182.62	-340	-842	-1329	-1788
2M		-157.38	-659.38	-1146.38	-1605.38
3M			-502	-989	-1448
6M				-487	-946
9M					-459



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