



【2024-10-16】

今日 Fixing 定在 7.1191，较上一交易日下调了 361 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

短端，O/N 成交在 -6.5~-6.1 的位置；T/N 成交在 -6.16~-6.09 的位置；S/N 成交在 -18.35~-18.2 的位置。1w 成交在 -43，-42.96，-42.65，-42.6 的位置；3w 成交在 -126.8 的位置；1s 成交在 -183，-182.8，-182.5 的位置；3s 成交在 -537，-535，-534，-530 的位置。

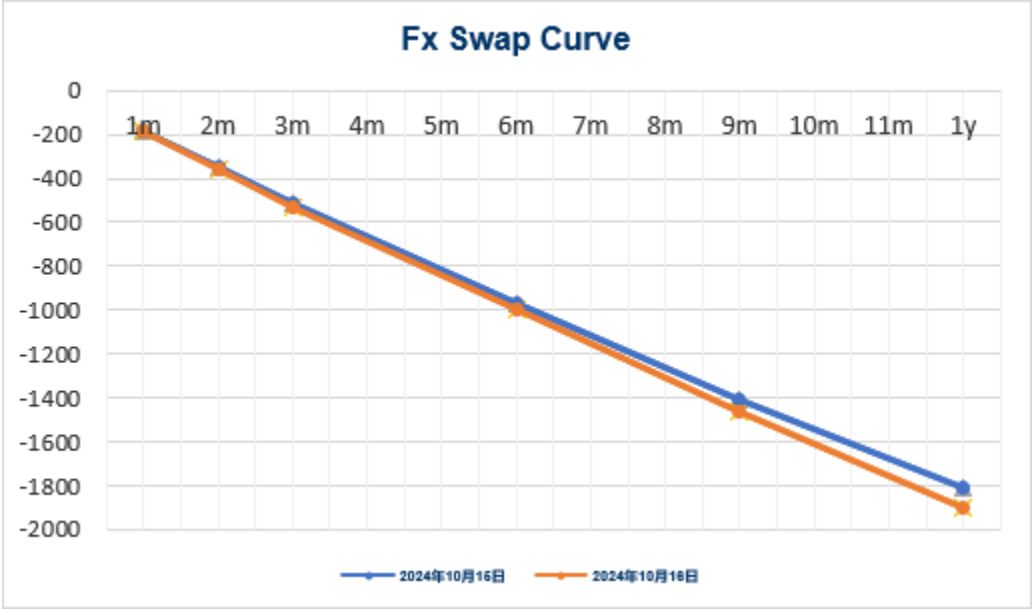
中长期限，6s 成交在 -1000，-998，-990 的位置；9s 成交在 -1450，-1415 的位置；1y 成交在 -1889，-1887，-1882，-1870，-1855 的位置。

超长期限，3y 成交在 -3700 的位置。

Spread 上，3s*1y 成交在 -1349，-1345 的位置；6s*1y 成交在 -885，-870 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-43	7.1107	-1.45
2W	14	-85	7.1065	-2
1M	33	-183	7.0967	1.7
2M	61	-355	7.0795	-5
3M	92	-537	7.0613	-25.6
6M	182	-1002	7.0148	-29
9M	273	-1465	6.9685	-55
1Y	365	-1901	6.9249	-93
18M	547	-2325	6.8825	0
2Y	730	-2900	6.8250	-80
3Y	1097	-3700	6.7450	25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1191	
CLOSING SPOT RATE			7.1150	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-172	-353.6	-819	-1282	-1718
2M		-181.6	-647	-1110	-1546
3M			-465.4	-928.4	-1364.4
6M				-463	-899
9M					-436



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