



【2024-10-25】

今日 Fixing 定在 7.1090，较上一交易日上调了 196 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

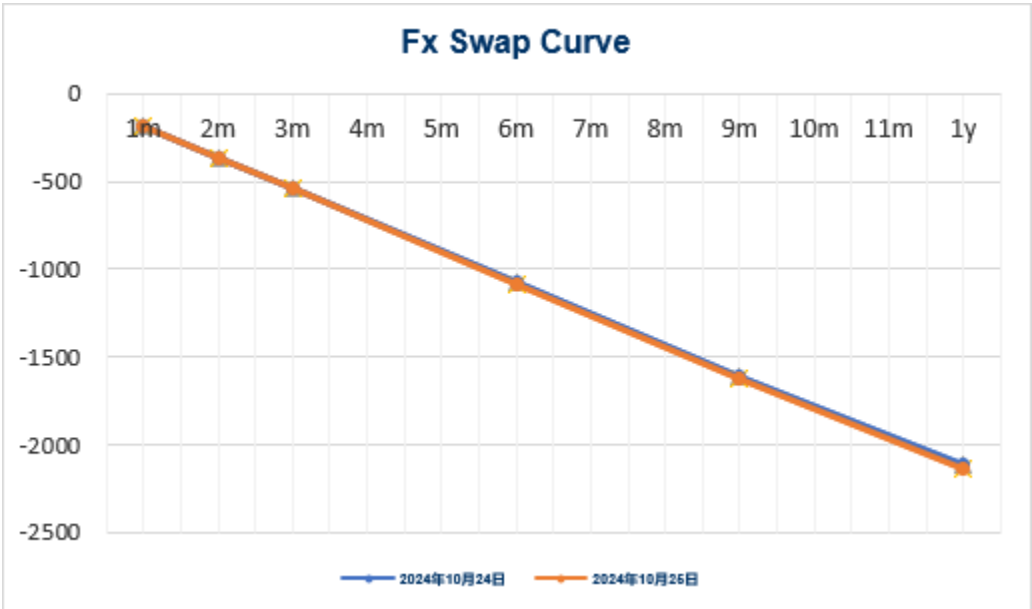
短端，O/N 成交在 -18~-17.7 的位置；T/N 成交在 -6.14~-5.7 的位置；S/N 成交在 -5.93~-5.76 的位置。1w 成交在 -40.3， -40.2， -40.1， -40 的位置；1s 成交在 -179.4， -179.3 的位置；3s 成交在 - 534， -523， -520 的位置。

中长期限，6s 成交在 -1094， -1092， -1088， -1077， -1071 的位置；1y 成交在 -2140， -2131， -2100， -2097 的位置。

Spread 上，1w*3w 成交在 -81.5 的位置；3s*6s 成交在 -547 的位置；6s*1y 成交在 -1024 的位置；6s*9s 成交在 -528 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.1179	0.08
2W	14	-82	7.1138	7
1M	31	-181	7.1038	6.4
2M	62	-366	7.0853	7
3M	90	-534	7.0685	7
6M	182	-1090	7.0129	-10
9M	273	-1618	6.9601	-3
1Y	365	-2140	6.9079	-25
18M	547	-2900	6.8319	0
2Y	730	-3470	6.7749	30
3Y	1095	-4400	6.6819	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1090	
CLOSING SPOT RATE			7.1219	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-185.71	-353.4	-909.4	-1437.4	-1959.4
2M		-167.69	-723.69	-1251.69	-1773.69
3M			-556	-1084	-1606
6M				-528	-1050
9M					-522



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