



【2024-11-07】

今日 Fixing 定在 7.1659，较上一交易日上升了 666 个 bp。各期限收盘价较上一交易日略微有所上升，今日交投较活跃。

短端，O/N 主要成交在-6.5~-5.9。 T/N 主要成交在-24~-23.6 的位置。 S/N 主要成交在-5.8~-5.67 的位置。 1w 成交在-41， -40.8， -40.6， -40.5， -40.3 的位置。 1s 成交在-169， -168， -167， -166.8， -166.5 等位置。 2s 成交在-343.2， -343.5， -343， -342 的位置。 3s 成交在-522， -520， -519， -518， -517， -516.5， -515 等位置。

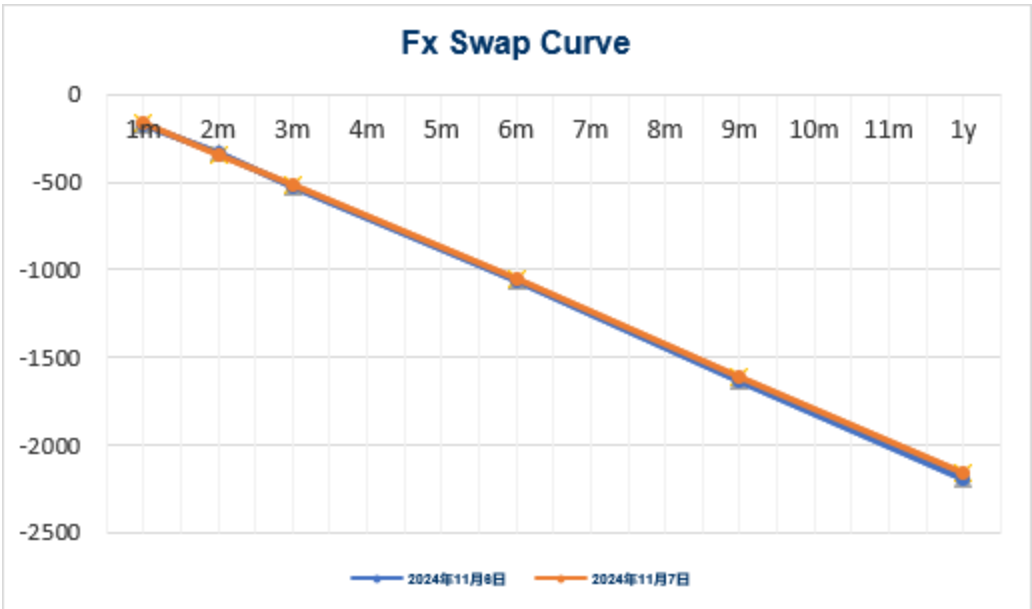
中长期， 6s 成交在-1075， -1070， -1065， -1064， -1063， -1060， -1056 等位置。 9s 成交在-1640， -1637， -1630， -1625， -1620， -1615 等位置。 1y 成交在-2230， -2218， -2195， -2198， -2200， -2193， -2187， -2185， -2175， -2170 等位置。

超长期限方面， 18s 成交在-3065， -3060 的位置。 3y 成交在-4780 的位置。

Spread 方面， 2*3s 成交在-174.5 的位置。 3*6s 成交在-550 的位置。 6*9s 成交在-565， -560 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	7.1563	0.6
2W	14	-79	7.1524	2
1M	30	-166	7.1437	7.2
2M	62	-341	7.1262	-4
3M	92	-513	7.1090	18
6M	181	-1055	7.0548	10
9M	273	-1615	6.9988	15
1Y	365	-2165	6.9438	27
18M	546	-3049	6.8554	11
2Y	730	-3700	6.7903	0
3Y	1095	-4725	6.6878	-25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1659	
CLOSING SPOT RATE			7.1603	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-174.9	-346.9	-888.9	-1448.9	-1998.9
2M		-172	-714	-1274	-1824
3M			-542	-1102	-1652
6M				-560	-1110
9M					-550



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