



【2024-10-09】

今日 Fixing 定在 7.0568，较上一交易日上调了 141 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

短端，O/N 成交在 -6.3~-5.5 的位置；T/N 成交在 -6.15~-5.78 的位置；S/N 成交在 -23.75~-23.58 的位置。1w 成交在 -41 的位置；2w 成交在 -81.8 的位置；1s 成交在 -196，-195，-194.5，-194 的位置；3s 成交在 -545，-543，-542，-535 的位置；4s 成交在 -690，-688 的位置；5s 成交在 -834.5，-834，-827，-825.5 的位置。

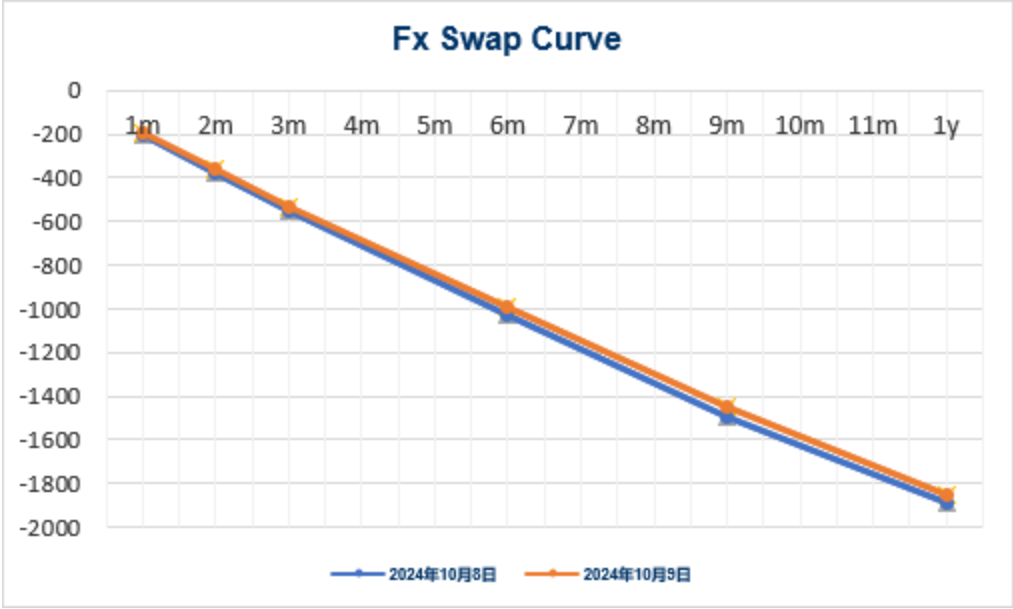
中长期限，6s 成交在 -994，-991，-990，-989 的位置；9s 成交在 -1455，-1450，-1443.5 的位置；1y 成交在 -1860，-1858，-1855，-1850 的位置。

超长期限，2y 成交在 -2900 的位置。

Spread 上，3s*9s 成交在 -910 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-42	7.0631	1.4
2W	14	-82	7.0591	6
1M	32	-192	7.0481	16.5
2M	61	-360	7.0313	14
3M	94	-537	7.0136	11
6M	182	-994	6.9679	36
9M	273	-1449	6.9224	45
1Y	368	-1857	6.8816	28
18M	549	-2475	6.8198	-10
2Y	732	-2870	6.7803	-5
3Y	1096	-3575	6.7098	-75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0568	
CLOSING SPOT RATE			7.0673	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-167.96	-345	-802	-1257	-1665
2M		-177.04	-634.04	-1089.04	-1497.04
3M			-457	-912	-1320
6M				-455	-863
9M					-408



文 / Edward Sun

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