



【2024-10-29】

今日美元/人民币中间价报 7.1283，较上一个交易日下调 24 bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-6.3~-6； T/N 成交在-5.95~-5.84； S/N 成交在-5.73~-5.5； 1w 成交在-40.6， -40.5； 1s 成交在-； 2s 成交在-356； 3s 成交在-523， -519。

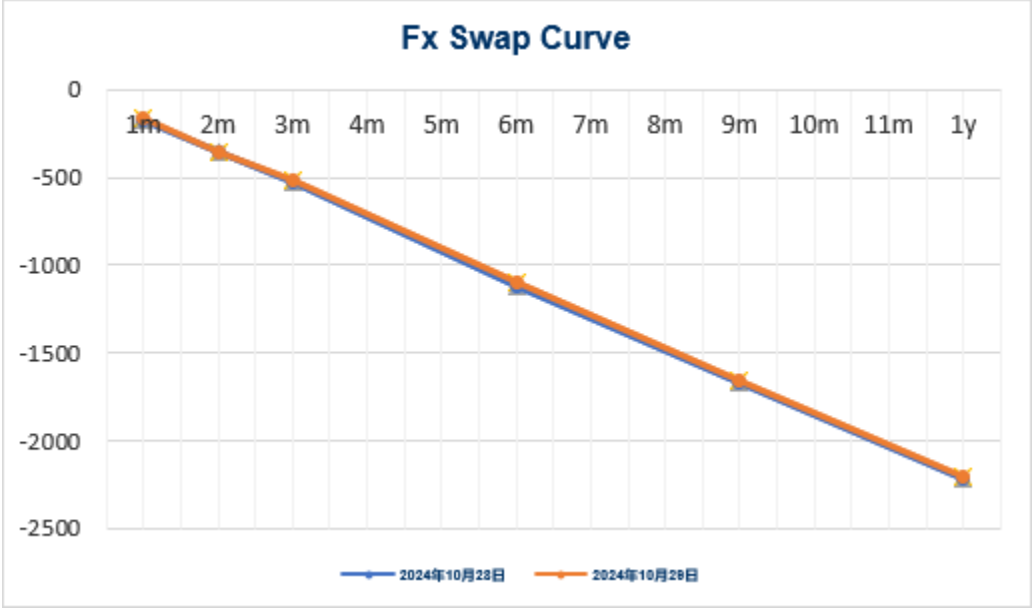
中长期限， 6s 成交在-1102~-1088； 9s 成交在-1652， -1640； 1y 成交在-2202， -2199， -2201， 最后收在-2200 附近。

超长期限， 4y 成交在-5000。

Spread 方面， 3w*1s 成交在-45.5； 3s*6s 成交在-577， -570.5； 6s*9s 成交在-553； 9s*1y 成交在-553。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.1377	0.61
2W	14	-81	7.1337	2
1M	29	-166	7.1251	8.3
2M	61	-356	7.1061	3
3M	88	-521	7.0896	11.5
6M	181	-1098	7.0319	19
9M	273	-1653	6.9765	14.5
1Y	365	-2210	6.9207	12
18M	546	-3050	6.8367	-30
2Y	729	-3700	6.7717	0
3Y	1093	-4590	6.6827	10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1283	
CLOSING SPOT RATE			7.1417	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-189.6	-354.6	-931.6	-1486.1	-2043.6
2M		-165	-742	-1296.5	-1854
3M			-577	-1131.5	-1689
6M				-554.5	-1112
9M					-557.5



文 / Edison Zeng

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