



【2024-10-31】

今日 Fixing 定在 7.1250，较上一交易日下降了 140 个 bp。各期限收盘价较上一交易日略微有所下降。

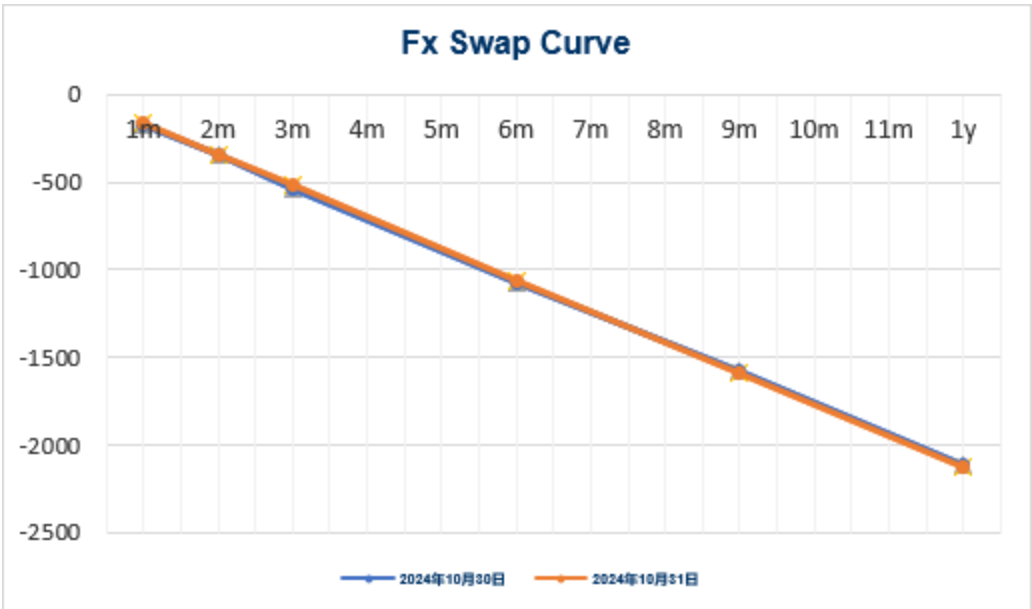
短端，O/N 主要成交在-5~-3.9。 T/N 主要成交在-17.4~-16.5 的位置。S/N 主要成交在-5.9~-5.66 的位置。1w 成交在-46， -45.7 的位置。1s 成交在-167， -165， -164， -164.5， -163.5， -163， -162.5 等位置。2s 成交在-350， -346， -347， -345， -344 的位置。3s 成交在-520， -523， -521， -519， -517.7， -515 等位置。

中长期限，6s 成交在-1070， -1068， -1065， -1066.5， -1063， -1060 等位置。9s 成交在-1600， -1595， -1592， -1590 等位置。1y 成交在-2130， -2125， -2121， -2132， -2135 等位置。

Spread 方面，1*2s 成交在-183.5 的位置。2*3s 成交在-172.5 的位置。3*6s 成交在-547， -548 的位置。5*6s 成交在-170 的位置。9*12s 成交在-540 的位置。6*12s 成交在-1060， -1070 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-46	7.1114	-6.4
2W	14	-80	7.1080	-2
1M	31	-163	7.0998	7.5
2M	62	-344	7.0816	7
3M	95	-515	7.0645	23.1
6M	186	-1065	7.0095	12
9M	273	-1595	6.9565	-15
1Y	367	-2131	6.9029	-14
18M	549	-2980	6.8180	-43.1
2Y	731	-3605	6.7555	-95
3Y	1095	-4580	6.6580	-120
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1250	
CLOSING SPOT RATE			7.1160	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-181.5	-352.5	-902.5	-1432.5	-1968.5
2M		-171	-721	-1251	-1787
3M			-550	-1080	-1616
6M				-530	-1066
9M					-536



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