



【2024-10-22】

今日美元/人民币中间价报 7.1223，较上一个交易日上调 241bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在 -5.9， -6； T/N 成交在 -5.95~-5.88； S/N 成交在 -5.92~-5.86； 1w 成交在 -41.6， -41.5； 2w 成交在 -83.8； 3s 成交在 -526， -527， -521。

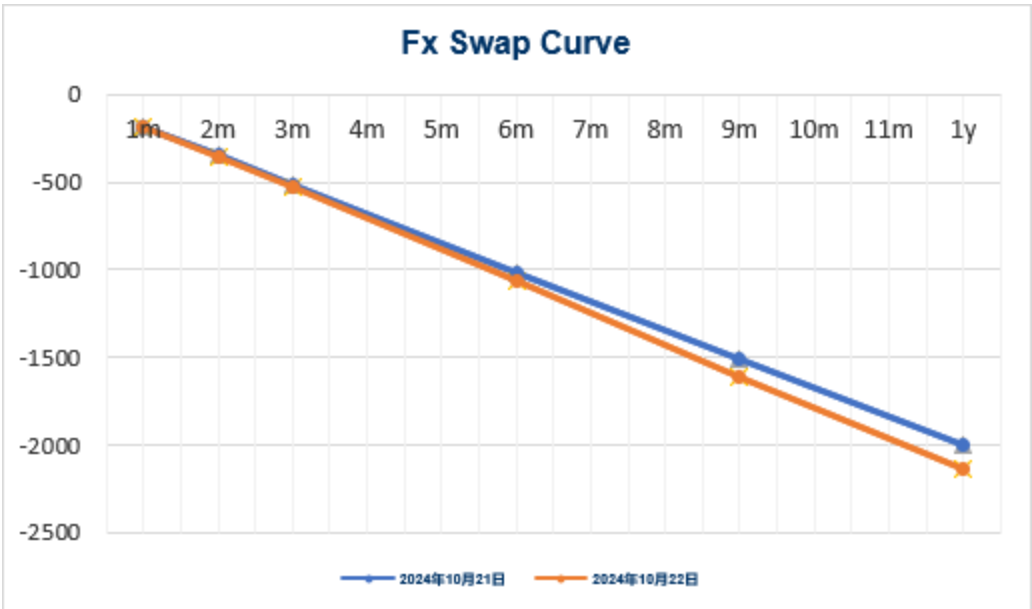
中长期限， 6s 成交在 -1055~-1030； 9s 成交在 -1580， -1560， -1550， -1551， -1545； 1y 成交在 -2050， 一路给到 2058， -2060， 下午继续给到 -2080， -2082， -2085， 最后收在 -2148 附近。

超长期限， 无。

Spread 方面， 6s*1y 成交在 -1018， 6s*9s 成交在 -525。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-42	7.1171	-0.02
2W	14	-83	7.1129	0
1M	33	-187	7.1025	1.61
2M	61	-355	7.0857	-10
3M	92	-527	7.0685	-13
6M	182	-1065	7.0147	-46
9M	273	-1610	6.9602	-97
1Y	365	-2142	6.9070	-147
18M	547	-2880	6.8332	-180
2Y	730	-3454	6.7758	-254
3Y	1097	-4225	6.6987	-340
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1223	
CLOSING SPOT RATE			7.1212	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-167.71	-339.71	-877.71	-1422.71	-1954.71
2M		-172	-710	-1255	-1787
3M			-538	-1083	-1615
6M				-545	-1077
9M					-532



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