附件：询价即期、远期、掉期期限说明

询价即期交易的期限是指到期日与交易日的日期间隔。询价远期交易的期限是指到期日与T+2日的日期间隔。询价掉期交易的期限包括近端期限和远端期限，期限规则同询价即期、远期交易期限。

期限分为标准期限和非标准期限，标准期限定义见下表。

|  |  |
| --- | --- |
| **期限名称** | **到期日** |
| TODAY | 交易当日（T) |
| TOM | 交易当日后的第一个交易日（T+1） |
| SPOT | 交易当日后的第二个交易日（T+2） |
| 1D | SPOT之后的第一个交易日（T+3） |
| 1W | SPOT之后一周 |
| 2W | SPOT之后两周 |
| 3W | SPOT之后三周 |
| 1M | SPOT之后一个月 |
| 2M | SPOT之后两个月 |
| 3M | SPOT之后三个月 |
| 4M | SPOT之后四个月 |
| 5M | SPOT之后五个月 |
| 6M | SPOT之后六个月 |
| 9M | SPOT之后九个月 |
| 1Y | SPOT之后一年 |

若遇交易所休市日，1M 以下标准期限对应的到期日顺延至下一交易日，1M 以上（含 1M）标准期限对应的到期日遵循“经调整的下一交易日”规则调整。其中，“经调整的下一交易日”指顺延至下一交易日，但如果下一交易日跨至下一月，则提前至上一交易日。

询价远期、掉期交易的交易期限应符合月末规则，即：若T+2日为某个月的最后一个交易日，则1M以上（含）标准期限的询价远期、掉期交易的到期日也应落在相应月份的最后一个交易日。