



【2024-02-01】

今日 Fixing 定在 7.1049，较上一交易日上升了 10 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端，O/N 主要成交在-6.8~-6。 T/N 主要成交在-20.2~-19.3 的位置。S/N 主要成交在-6.7~-6.5 的位置。2w 成交在-101， -100.5， -100， -99.5， -99， -99.7 的位置。3w 成交在-141， -140， -139， -139.5， -140.1， -139.8 的位置。1s 成交在-195， -194.5， -194， -194.3 等位置。2s 成交在-432， -431.5 的位置。3s 成交在-626 等位置。

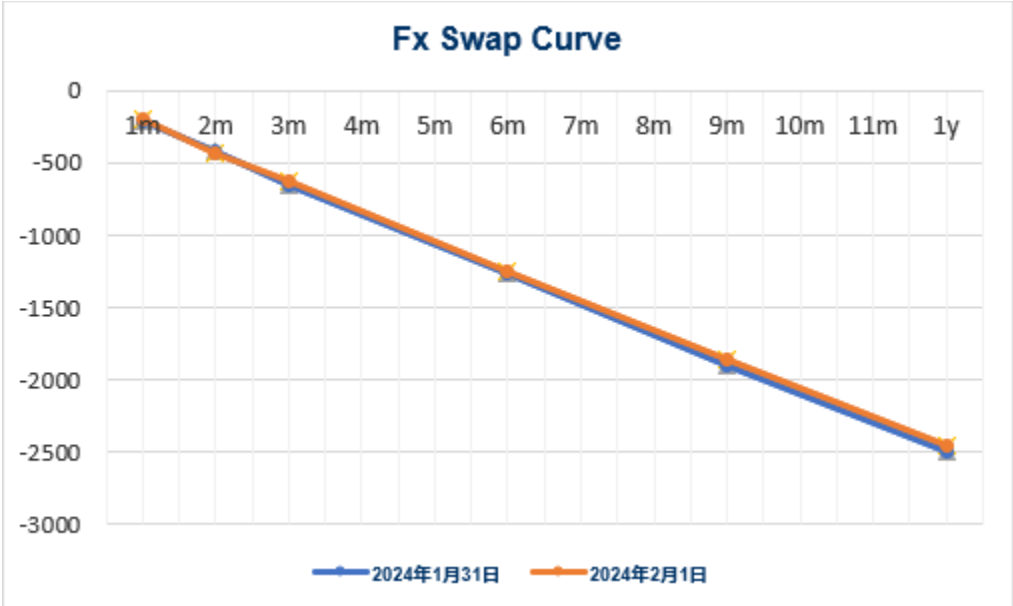
中长期限，6s 成交在-1250， -1252， -1253， -1251， -1248 等位置。9s 成交在-1868， -1867， -1865， -1863 等位置。1y 成交在-2457， -2455， -2458， -2460， -2465， -2463， -2464， -2462， -2460， -2458， -2455 等位置。

超长期限，18s 成交在-3360， -3350 的位置。

Spread 方面，2w*3w 成交在-40.5 的位置。3*6s 成交在-624.5 的位置。9*12s 成交在-594 的位置。6*12s 成交在-1205， -1203， -1210 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	15	-99	7.1733	-52.3
2W	15	-99	7.1733	24
1M	29	-194	7.1638	14.1
2M	63	-431	7.1401	-18
3M	91	-626	7.1206	24
6M	182	-1247	7.0585	11
9M	274	-1864	6.9968	31.5
1Y	366	-2454	6.9379	49
18M	547	-3365	6.8467	-15
2Y	731	-3974	6.7858	26
3Y	1103	-4900	6.6932	200
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1049	
CLOSING SPOT RATE			7.1832	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-236.7	-431.7	-1052.7	-1669.7	-2259.2
2M		-195	-816	-1433	-2022.5
3M			-621	-1238	-1827.5
6M				-617	-1206.5
9M					-589.5



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