



【2024-02-06】

今日美元/人民币中间价报 7.1082，较上一个交易日上调 12 个 bp，全天掉期市场交投活跃。

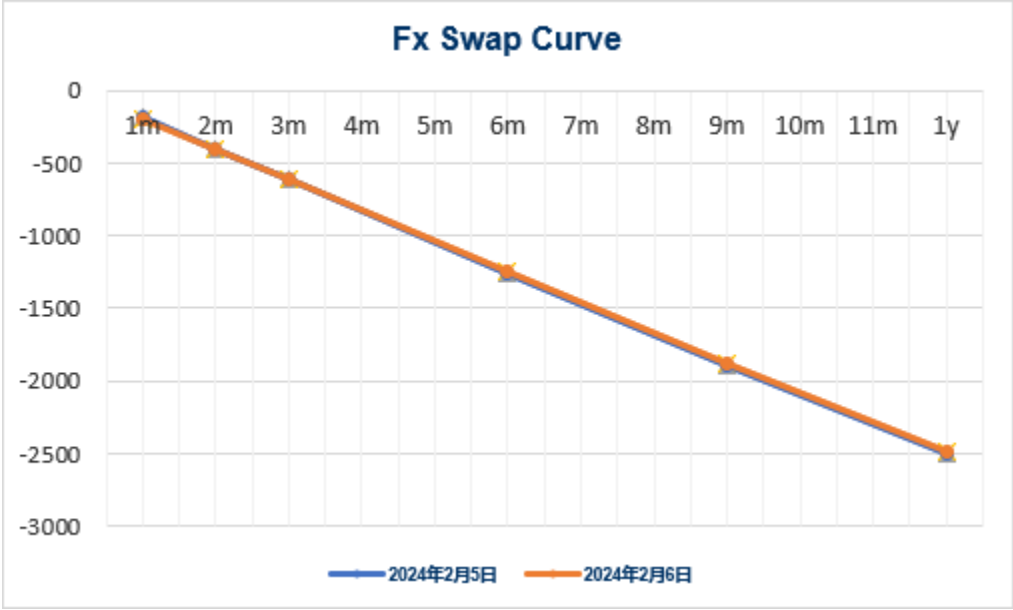
O/N 成交在-5.8， -6； T/N 成交在-6.6~-5.65； S/N 成交在-6.3~-6.18； 1w 成交在-78.5， -78.3， -80。 3， -80； 2w 成交在-93， -91.5， -90.5， -90.3； 3w 成交在-137； 1s 成交在-194， -193， -192.5， -191.5， -190； 3s 成交在-620， -619.5， -619， -618。

中长期限， 6s 成交在-1257， -1250， -1250.5； 9s 成交在-1895； 1y 成交在-2518， -2516， -2512， -2517， -2505， -2497， -2496， -2490。

Spread 方面， 1w\*2w 成交在-13； 3s\*6s 成交在-632.5； 6s\*9s 成交在-635； 3s\*1y 成交在-1885； 9s\*1y 成交在-621。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 12   | -79        | 7.1834       | 3.8        |
| 2W                      | 14   | -93        | 7.1820       | -4         |
| 1M                      | 29   | -193       | 7.1720       | -4.8       |
| 2M                      | 60   | -409       | 7.1504       | 1          |
| 3M                      | 90   | -617       | 7.1296       | -5.2       |
| 6M                      | 182  | -1249      | 7.0664       | 14         |
| 9M                      | 274  | -1875      | 7.0038       | 23         |
| 1Y                      | 368  | -2489      | 6.9424       | 17         |
| 18M                     | 547  | -3400      | 6.8513       | -10        |
| 2Y                      | 732  | -4100      | 6.7813       | 0          |
| 3Y                      | 1100 | -5275      | 6.6638       | 50         |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 7.1082       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 7.1913       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |      |        |        |         |         |
|---------------------|------|--------|--------|---------|---------|
|                     | 2M   | 3M     | 6M     | 9M      | 1Y      |
| 1M                  | -216 | -424.2 | -1056  | -1682   | -2296   |
| 2M                  |      | -208.2 | -840   | -1466   | -2080   |
| 3M                  |      |        | -631.8 | -1257.8 | -1871.8 |
| 6M                  |      |        |        | -626    | -1240   |
| 9M                  |      |        |        |         | -614    |



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**