



【2024-01-30】

今日美元/人民币中间价报 7.1055，较上一个交易日下调 42 个 bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-7.4~-7.25； T/N 成交在-7.25~-6.88； S/N 成交在-7.23； 1w 成交在-50.2~-49； 2w 成交在-135, -134, -133.9； 3w 成交在-149； 1s 成交在-205； 3s 成交在-670, -675, -673, -672。

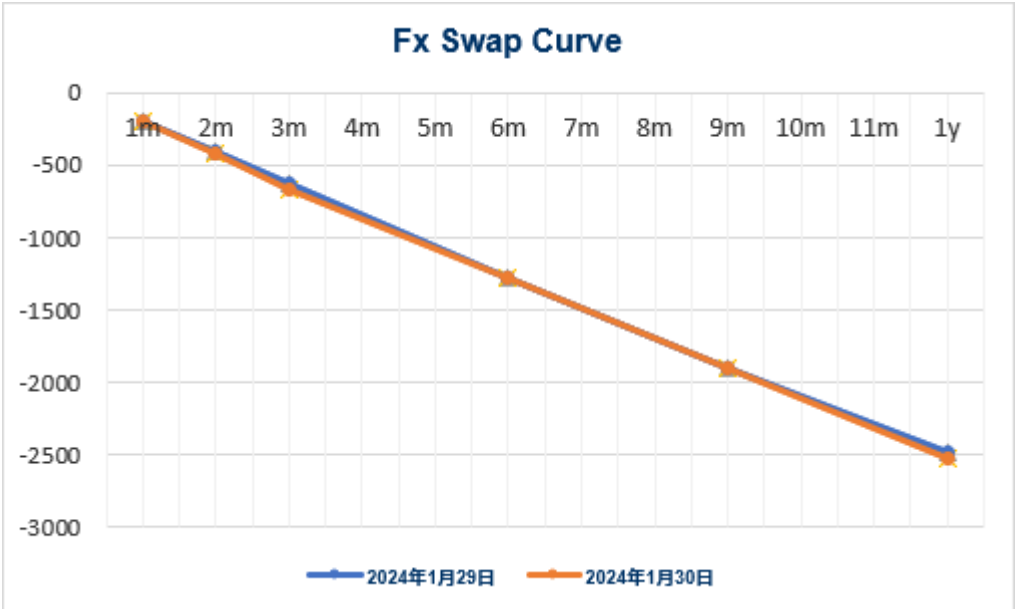
中长期限，6s 成交在-1290, -1286, -1285, -1283, -1282； 9s 成交在-1910； 1y 成交在-2550, -2553, -2549, -2551, -2550, -2545。

超长期限， 15s 成交在-3020； 3y 成交在-5130。

Spread 方面， 2w*3w 成交在-14； 2w*1s 成交-70, -68.5； 3s*6s 成交在-615； 6s*9s 成交在-631； 6s*1y 成交在-1265, -1262, -1260。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-50	7.1723	-0.92
2W	20	-134	7.1639	6
1M	29	-203	7.1570	-0.3
2M	58	-423	7.1350	-16
3M	90	-670	7.1103	-38.5
6M	182	-1277	7.0497	-6
9M	274	-1900	6.9873	-2
1Y	362	-2529	6.9244	-49
18M	547	-3340	6.8433	-10
2Y	730	-4045	6.7728	-45
3Y	1094	-5205	6.6568	-115
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1055	
CLOSING SPOT RATE			7.1773	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-219.78	-466.7	-1073.2	-1696.7	-2325.7
2M		-246.92	-853.42	-1476.92	-2105.92
3M			-606.5	-1230	-1859
6M				-623.5	-1252.5
9M					-629



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