



【2024-02-05】

今日 Fixing 定在 7.1070 ，较上一交易日上调了 64 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 成交在 -5.9~-5.5 ， T/N 成交在 -6.3~-5.8 ， S/N 成交在 -6.3~-6 。1w 成交在-83.2, -82, -81.5, -81 的位置；2w 成交在 -88 的位置；

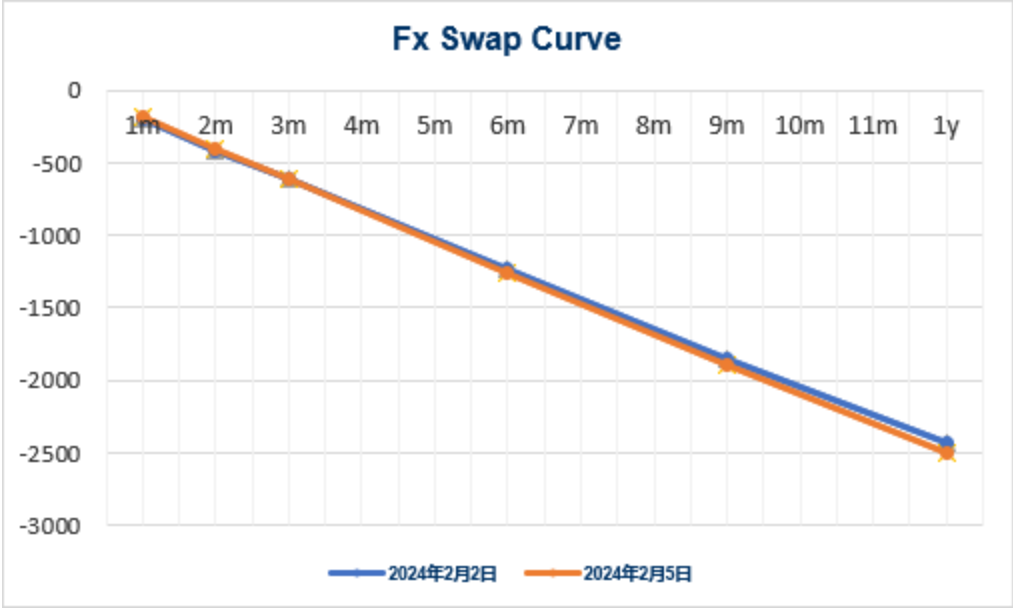
1s 成交在 -188 ， -187 的位置；2s 成交在 -414, -413, -412 的位置；3s 反复成交在 -614, -613, -612 的位置；

中长期限，6s 成交在 -1266, -1263, -1261, -1260, -1256 的位置；9s 成交在 -1895, -1892, -1890, -1888 的位置；1y 反复成交在 -2520, -2515, -2510, -2508, -2505, -2500, -2498 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在 -6 的位置； 6s*1y 成交在 -1252, -1250 的位置；9s*1y 成交在-610 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	13	-83	7.1899	6.2
2W	14	-89	7.1893	0
1M	29	-188	7.1794	2.2
2M	61	-410	7.1573	8
3M	90	-612	7.1370	-2.46
6M	182	-1263	7.0719	-25
9M	274	-1898	7.0084	-51
1Y	366	-2506	6.9476	-71
18M	547	-3390	6.8592	-130
2Y	733	-4100	6.7882	-200
3Y	1101	-5325	6.6657	-325
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1070	
CLOSING SPOT RATE			7.1982	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-221.3	-423.8	-1074.8	-1709.8	-2317.8
2M		-202.5	-853.5	-1488.5	-2096.5
3M			-651	-1286	-1894
6M				-635	-1243
9M					-608



文 / Ray Yan

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