



【2024-01-29】

今日 Fixing 定在 7.1097，较上一交易日上调了 23 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 -6.96~-6.9，T/N 成交在 -6.95~-6.88，S/N 成交在 -6.92~-6.9。1w 成交在-48.68, -48.65,-48.6, -48.5 的位置；2w 成交在 -139.9,-139.6 的位置；

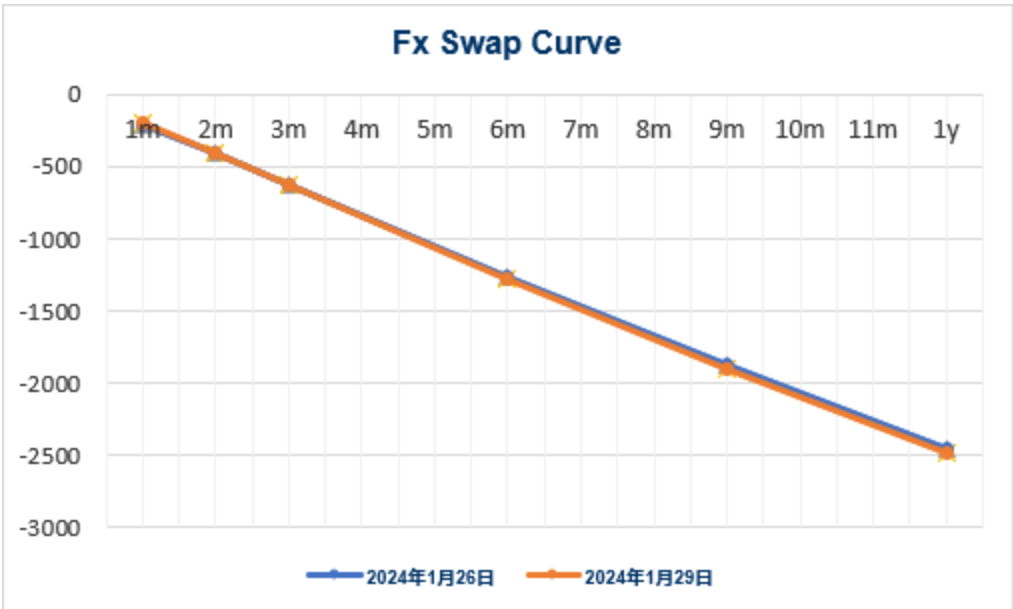
1s 成交在 -203.2, -203.1,-203,-202.8 的位置；2s 成交在 -407.5 的位置；3s 反复成交在-632,-631.4 的位置；

中长期限，6s 成交在 -1274, -1273 ,-1272 的位置；9s 成交在 -1899 的位置；1y 反复成交在 -2485, -2480,-2479, -2478,-2477.5, -2476, -2470, -2469, -2466 的位置。

Spread 上，2w*3w 成交在 -7.1, -7 的位置；6s*1y 成交在 -1210 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-49	7.1748	-0.56
2W	20	-140	7.1657	5
1M	29	-203	7.1594	4.5
2M	58	-407	7.1390	3
3M	90	-632	7.1166	1.8
6M	182	-1271	7.0526	-12
9M	274	-1898	6.9899	-24
1Y	362	-2480	6.9317	-30
18M	547	-3330	6.8467	-10
2Y	730	-4000	6.7797	-60
3Y	1094	-5090	6.6707	-40
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1097	
CLOSING SPOT RATE			7.1797	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-204	-428.5	-1068	-1695	-2277
2M		-224.5	-864	-1491	-2073
3M			-639.5	-1266.5	-1848.5
6M				-627	-1209
9M					-582



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