



【2024-01-26】

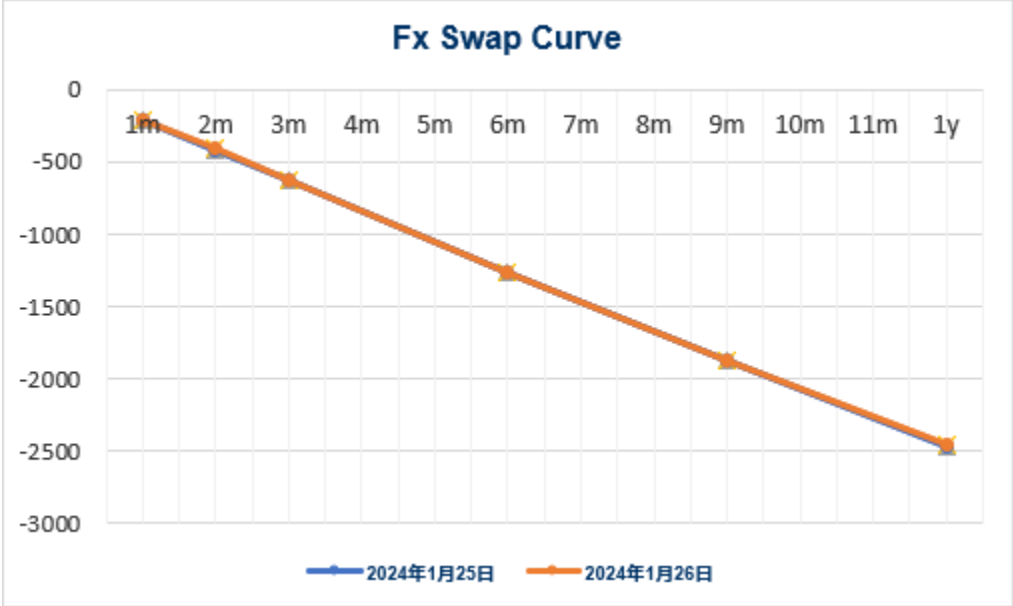
今日 Fixing 定在 7.1074，较上一交易日上调了 30 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅上涨。

短端，O/N 成交在-21~-20。T/N 成交在-6.84~-6.7。S/N 成交在-6.84~-6.82。1w 成交在-48.2~-48.08。3w 成交在-144.9。1s 成交在-208.5~-207.5。2s 成交在-410。3s 成交在-633~-632.5，尾盘收在-633.3。

中长期限，6s 成交在-1261~-1258。9s 成交在-1877。1y 成交在-2454~-2436，尾盘收在-2453。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.1760	0.11
2W	21	-145	7.1663	6
1M	30	-208	7.1601	7
2M	59	-410	7.1398	4
3M	91	-633	7.1175	0.7
6M	182	-1259	7.0549	3
9M	274	-1874	6.9934	5
1Y	363	-2450	6.9358	13
18M	547	-3320	6.8488	-20
2Y	731	-3940	6.7868	-40
3Y	1095	-5050	6.6758	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1074	
CLOSING SPOT RATE			7.1808	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-202.5	-425.8	-1051.5	-1666.5	-2242.5
2M		-223.3	-849	-1464	-2040
3M			-625.7	-1240.7	-1816.7
6M				-615	-1191
9M					-576



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