



【2024-01-23】

今日美元/人民币中间价报 7.1117，较上一个交易日上调 12 个 bp，全天掉期市场交投活跃。

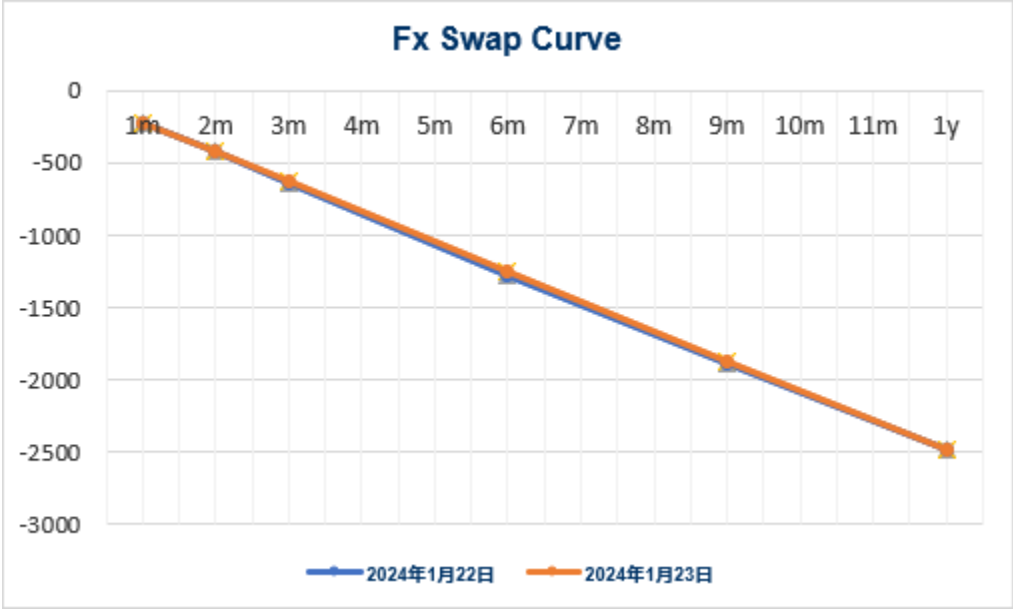
O/N 成交在-6.7~-6.6； T/N 成交在-6.83~-6.67； S/N 成交在-6.82~-6.72； 1w 成交在-47.7， -47.66； 3w 成交在-179； 1s 成交在-218.85， -218.5； 2s 成交在-415， -414.5； 3s 成交在-629.5， -629.3， -629。

中长期限， 6s 成交在-1268， -1263， -1260； 9s 成交在-1887； 1y 成交在-2498， -2485， -2480， -2490， -2488， 后面一路买到-2482， -2467， -2465， 最后收在-2476 附近。

Spread 方面， 9s*12s 成交在-601， -600。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.1647	0.06
2W	14	-96	7.1599	0
1M	26	-219	7.1476	8.2
2M	60	-416	7.1279	8
3M	91	-630	7.1066	5.5
6M	182	-1257	7.0438	17
9M	274	-1878	6.9817	16
1Y	368	-2479	6.9216	10
18M	547	-3300	6.8395	65
2Y	732	-3950	6.7745	25
3Y	1096	-5000	6.6695	-1
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1117	
CLOSING SPOT RATE			7.1695	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-196.3	-410.2	-1037.7	-1658.7	-2259.7
2M		-213.9	-841.4	-1462.4	-2063.4
3M			-627.5	-1248.5	-1849.5
6M				-621	-1222
9M					-601



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