

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NIX International Money Broking

【2024-01-31】

今日美元/人民币中间价报 7.1039，较上一个交易日下调 16bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 成交在-6.8~-6.7 之间；TN 早盘从-6.85 一路买到-6.83、-6.81、-6.71、-6.7、-6.64，午后再买到-6.4；SN 从-20.35 买到-20.3、-20.16。1W 成交在-47 附近；2W 成交在-123.5~-123 附近。1S 在-210.5~-209 之间反复成交；2S 成交在-413 附近；3S 成交在-658~-650 附近。

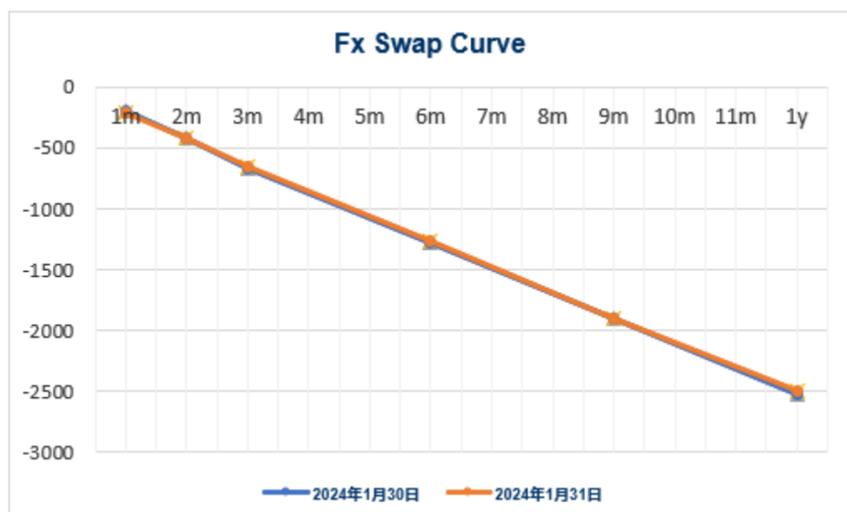
中长期，6S 成交在-1263~-1256.5 附近；9S 从-1905 买到-1890；1Y 从-2505 一路买到-2495，后又给回-2510，又再买到-2500。

超长期限，18S 市场成交-3390 附近，我们在-3350、-3345 附近，3Y 成交在-5100。

Spread 方面，2*3S 成交在-237，3*4S 成交在-196，4*5S 成交在-203，6*12S 成交在-1240、-1241，1*3Y 成交在-2600。

| Tenor | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W | 7 | -47 | 7.1748 | 2.9 |
| 2W | 18 | -123 | 7.1672 | 11 |
| 1M | 31 | -208 | 7.1587 | -5.1 |
| 2M | 60 | -413 | 7.1382 | 10 |
| 3M | 94 | -650 | 7.1145 | 20 |
| 6M | 182 | -1258 | 7.0537 | 19 |
| 9M | 276 | -1896 | 6.9900 | 4.5 |
| 1Y | 368 | -2502 | 6.9293 | 27 |
| 18M | 549 | -3350 | 6.8445 | -10 |
| 2Y | 731 | -4000 | 6.7795 | 45 |
| 3Y | 1096 | -5100 | 6.6695 | 105 |
| CNY CENTRAL PARITY RATE | | | 7.1039 | |
| CLOSING SPOT RATE | | | 7.1795 | |

| USD/CNY Spread Ref. | | | | | |
|---------------------|--------|--------|---------|---------|---------|
| | 2M | 3M | 6M | 9M | 1Y |
| 1M | -204.6 | -441.6 | -1049.6 | -1687.1 | -2293.6 |
| 2M | | -237 | -845 | -1482.5 | -2089 |
| 3M | | | -608 | -1245.5 | -1852 |
| 6M | | | | -637.5 | -1244 |
| 9M | | | | | -606.5 |



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