



【2024-02-02】

今日 Fixing 定在 7.1006，较上一交易日下调了 43 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅上涨。

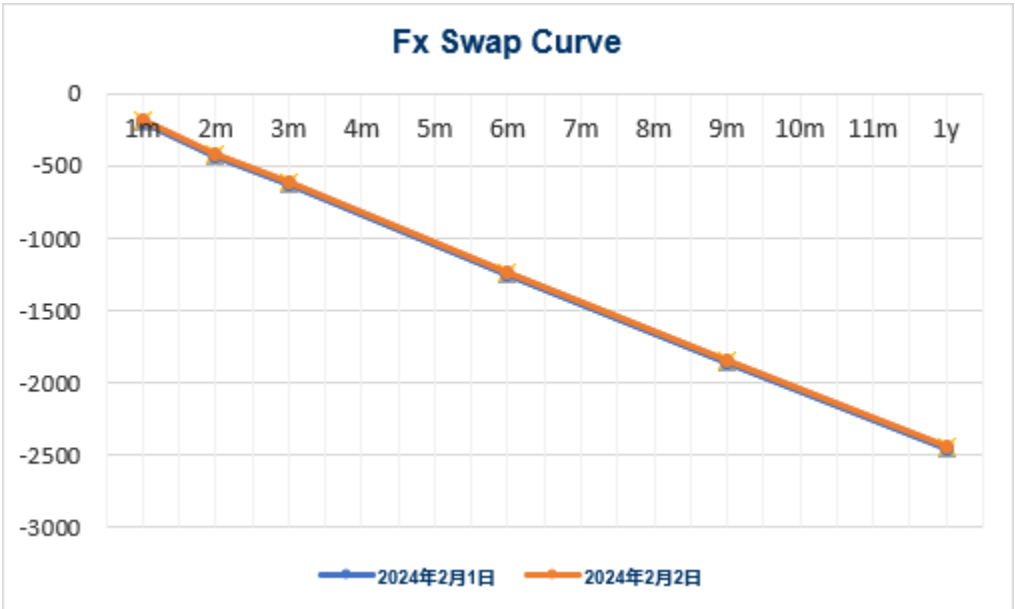
短端，O/N 成交在-19.8~-19.35。T/N 成交在-6.5~-5.9。S/N 成交在-6.5~-6.15。2w 成交在-91~-88.8。3w 成交在-136.5~-135.5。1s 成交在-192~-189.5。2s 成交在-417~-415。3s 成交在-610~-608，尾盘收在-609。4s 成交在-823。

中长期，6s 成交在-1240~-1235。9s 成交在-1848。1y 成交在-2435~-2421，尾盘收在-2435。

Spread 上，2w*3w 成交在-47， -46.8。2w*1s 成交在-101。1*2s 成交在-228。2*3s 成交在-192。1*12s 成交在-2236.5。3*12s 成交在-1822。6*12s 成交在-1200， -1192， -1192.5。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	14	-89	7.1704	9.7
2W	14	-89	7.1704	10
1M	29	-190	7.1603	3.9
2M	62	-417	7.1376	14
3M	90	-610	7.1183	16.46
6M	182	-1238	7.0555	9
9M	274	-1847	6.9946	17
1Y	366	-2435	6.9358	19
18M	547	-3260	6.8533	105
2Y	731	-3900	6.7893	74
3Y	1102	-5000	6.6793	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1006	
CLOSING SPOT RATE			7.1793	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-226.6	-419.14	-1047.6	-1656.6	-2244.6
2M		-192.54	-821	-1430	-2018
3M			-628.46	-1237.46	-1825.46
6M				-609	-1197
9M					-588



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

禁止处理涉密信息和内部敏感信息

禁止处理涉密信息和内部敏感信息

禁止处理涉密信息和内部敏感信息

禁止处理涉密信息和内部敏感信息