

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2024-01-25】

今日 Fixing 定在 7.1044, 较上一交易日下降了 9 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所下降。

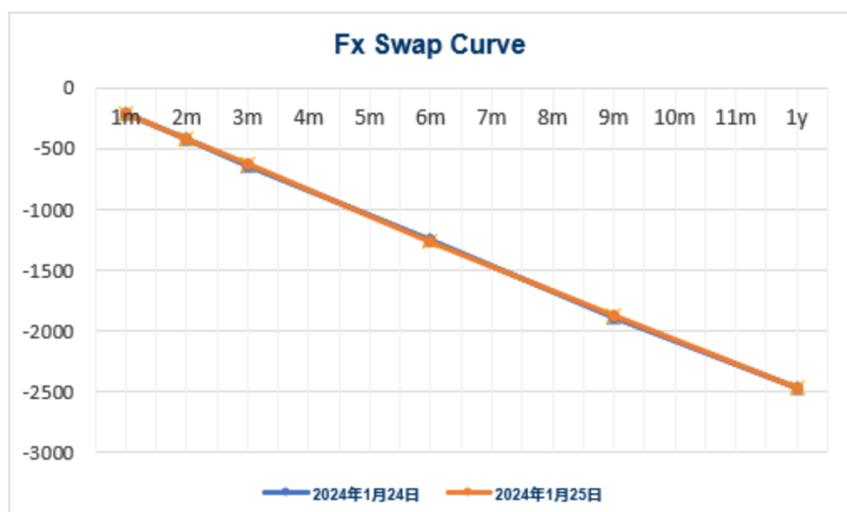
短端, O/N 主要成交在-6.9~-6.5。 T/N 主要成交在-20.5~-20.3 的位置。 S/N 主要成交在-6.85~-6.82 的位置。 1w 成交在-48.3, -48.1, -48.2, -48.22 的位置。 3w 成交在-151.2 的位置。 1s 成交在-214, -214.5 等位置。 2s 成交在-416 的位置。 3s 成交在-634.5, -634 等位置。

中长期, 6s 成交在-1258, -1260, -1262 等位置。 9s 成交在-1867, -1870, -1872, -1875, -1877, -1875 等位置。 1y 成交在-2465, -2464, -2460, -2458, -2456, -2455, -2452, -2455, -2457, -2456, -2458, -2460, -2464 等位置。

Spread 方面, 2\*3s 成交在-218.5 的位置, 9\*12s 成交在-585, -583 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-48	7.1631	0.17
2W	22	-151	7.1528	-55
1M	22	-215	7.1465	0
2M	60	-414	7.1265	2
3M	91	-634	7.1045	1
6M	182	-1262	7.0417	-5
9M	274	-1879	6.9800	9
1Y	364	-2463	6.9216	7
18M	547	-3300	6.8379	20
2Y	731	-3900	6.7779	50
3Y	1096	-5000	6.6679	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1044	
CLOSING SPOT RATE			7.1679	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-199.1	-419.5	-1047.5	-1664.5	-2248.5
2M		-220.4	-848.4	-1465.4	-2049.4
3M			-628	-1245	-1829
6M				-617	-1201
9M					-584



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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)