



【2025-01-06】

今日美元/人民币中间价报 7.1876，较上一个交易日下调 2bp，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

ON 成交在-4.4~-3.8；TN 成交在-3.65~-3；SN 成交在 -3.65~-3.3 之间。

1w 成交在 -28，-27.5，-27 的位置；2w 成交在 -59 的位置； 1S 反复成交在 -153~-148 之间 ；2s 成交在 -305，-304 附近 ；3s 成交在 -480，-479，-478，-477 附近；4s 成交在-666 的位置。

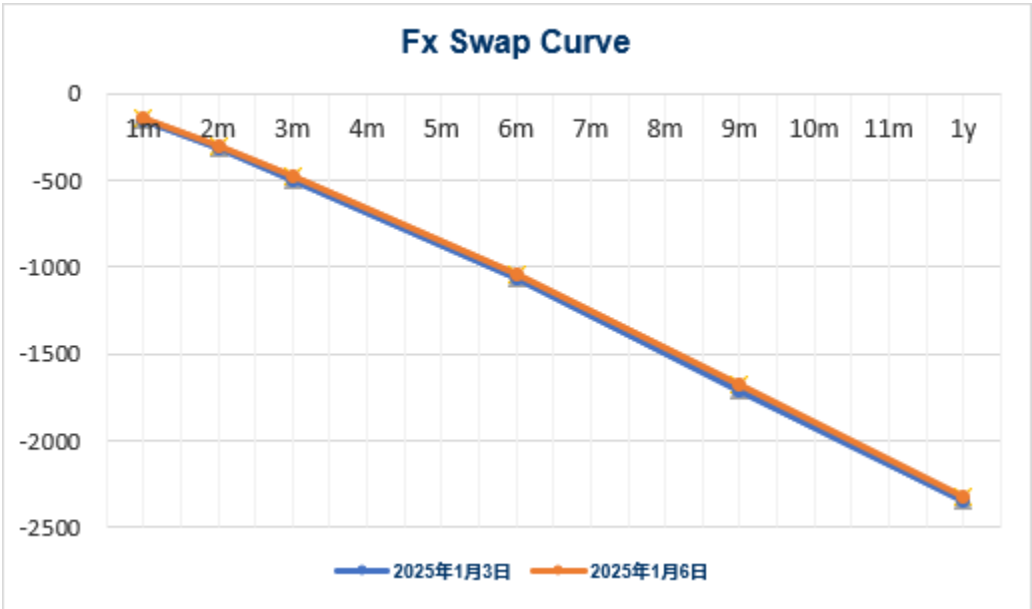
中长期限，6s 成交在 -1050，-1045，-1044，-1043，-1042，-1041，-1040 尾盘收在 -1043 附近；9S 成交在-1685，-1680，-1677 尾盘收在-1677 附近；10s 成交在-1900 的位置；11s 成交在-2110 的位置；1Y 从 -2355 买到 -2347，-2345，-2340，-2335 附近，午后成交在 -2340 附近，随后买到-2332，-2330，-2315 的位置；尾盘收在 -2318。

超长期限，18s 成交在-3380 的位置。

Spread 方面，1s*2s 成交在-156 的位置；6s*1y 成交在-1285，-1282,-1280,-1278,-1270；10s*12s 成交在-410；11s*12s 成交在-214 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-27	7.3269	5.98
2W	14	-55	7.3241	11
1M	28	-147	7.3149	4
2M	61	-303	7.2993	7
3M	90	-475	7.2821	19
6M	181	-1043	7.2253	27
9M	274	-1677	7.1619	36
1Y	365	-2318	7.0978	28
18M	546	-3380	6.9916	120
2Y	730	-4325	6.8971	75
3Y	1097	-5950	6.7346	150
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1876	
CLOSING SPOT RATE			7.3296	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-156	-328	-896	-1530	-2171
2M		-172	-740	-1374	-2015
3M			-568	-1202	-1843
6M				-634	-1275
9M					-641



文 / Ray Yan

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