

收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列

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

【2025-01-17】

今日 Fixing 定在 7.1889，较上一交易日上调了 8 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅下跌。

短端，O/N 成交在-18~-13。S/N 成交在-5.45~-4.95。2w 成交在-72~-70。1s 成交在-156~-154。2s 成交在-312.5~-307。3s 成交在-488~-485。

中长期限，6s 成交在-1058~-1050。9s 成交在-1668~-1652。1y 成交在-2300~-2270，尾盘收在-2294。

长期限上，18s 成交在-3330~-3295。2y 成交在-4370。3y 成交在-5830，-5810。

Spread 上，3*12s 成交在-1810。9*12s 成交在-630~-625。6*12s 成交在 -1229，-1230。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	15	-71	7.3213	-4
2W	15	-71	7.3213	-4
1M	31	-157	7.3127	-6.2
2M	59	-312	7.2972	-2
3M	90	-489	7.2795	-8.8
6M	181	-1056	7.2228	-17
9M	273	-1665	7.1619	-20
1Y	365	-2298	7.0986	-21

18M	546	-3330	6.9954	-15
2Y	730	-4250	6.9034	0
3Y	1095	-5810	6.7474	15
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1889	
CLOSING SPOT RATE			7.3284	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-155.3	-332.1	-899.3	-1508.3	-2141.3
2M		-176.8	-744	-1353	-1986
3M			-567.2	-1176.2	-1809.2
6M				-609	-1242
9M					-633

