

收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列



【2025-01-15】

今日美元/人民币中间价报 7.1883，较上一个交易日上调 5bp，各期限收盘价较上一交易日略微下行。

ON 成交在-4.5~-3 之间，反复成交在-3.8、-3.5；TN 早盘从-5.1 一路买到-4.65，午后又买到-4.2、-4.1、4；SN 从-19.32 买到-19.31、-19.2、-19。1W 成交在-34；2W 从-93.5 买到-93.1；3W 从-106 买到-104。1S 从-167 买到-161.5；2S 成交在-312.2~-309.5 附近；3S 从-491 买到-490、-489；4S 成交在-684。

中长期限，6S 成交在-1057~-1048 附近；9S 成交在-1660；1Y 早盘从-2315 买到-2314，午后给到-2318、-2323，后又买回-2318、-2306，接着给到-2309、-2315。

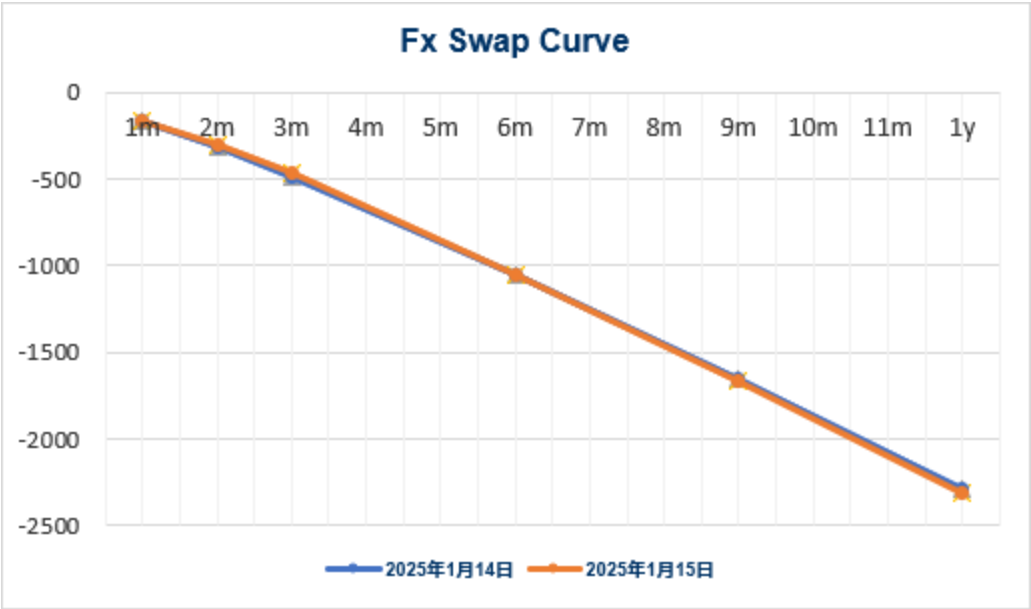
超长期限，18S 成交在-3330，2Y 成交在-4285、-4275；3Y 成交在-5850。

Spread 方面，6*12S 成交在-1275。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	7.3286	0.36
2W	19	-93	7.3226	5

1M	21	-160	7.3159	5.3
2M	59	-308	7.3011	7
3M	90	-470	7.2849	20.5
6M	181	-1050	7.2269	-1
9M	273	-1660	7.1659	-4
1Y	368	-2316	7.1003	-26
18M	546	-3330	6.9989	-15
2Y	732	-4280	6.9039	10
3Y	1096	-5860	6.7459	-10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1883	
CLOSING SPOT RATE			7.3319	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-148	-310	-890	-1500	-2156
2M		-162	-742	-1352	-2008
3M			-580	-1190	-1846
6M				-610	-1266
9M					-656



文 / Cathy He

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