

收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列



【2025-01-20】

今日 Fixing 定在 7.1886，较上一交易日下调了 3 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅下跌。

短端，T/N 成交在 -5.3~-4.8。S/N 成交在 -5.3~-4.8。2w 成交在 -69~-68。3w 成交在 -103。1s 成交在 -169~-167。2s 成交在 -324~-323。3s 成交在 -493~-489。

中长期限，6s 成交在 -1063~-1055。9s 成交在 -1675~-1665。1y 成交在 -2315~-2300，尾盘收在 -2315。

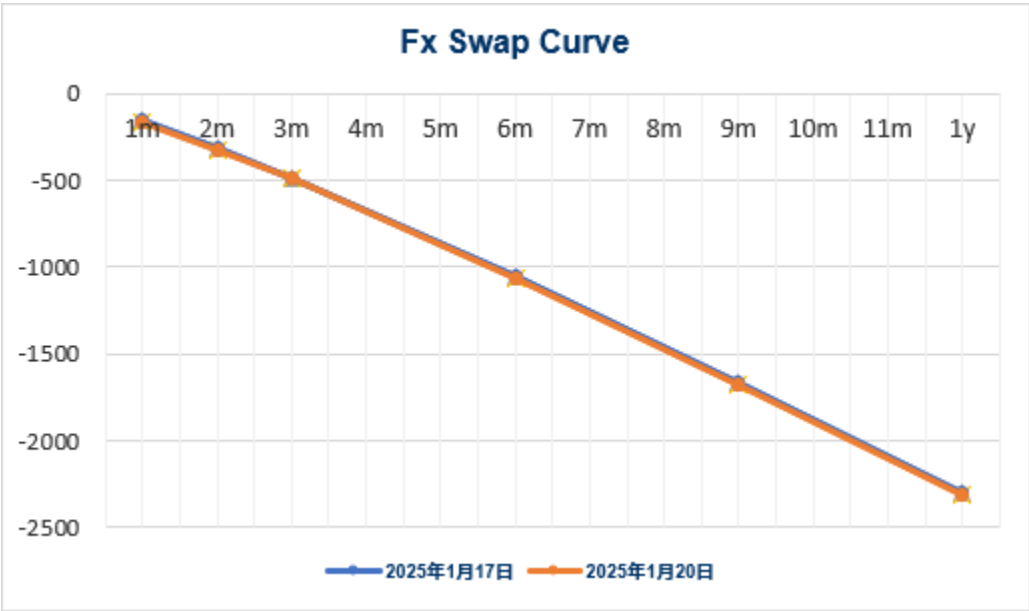
长期限上，18s 成交在 -3350。

Spread 上，6*12s 成交在 -1255~-1250。9*12s 成交在 -638。12*18s 成交在 -1035。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward (Mid)	Δ SWAP PIPS
1W	14	-68	7.3093	3
2W	14	-68	7.3093	3
1M	33	-166	7.2995	-9
2M	61	-327	7.2834	-15
3M	90	-490	7.2671	-1.2

6M	181	-1060	7.2101	-4
9M	273	-1677	7.1484	-12
1Y	365	-2316	7.0845	-18
18M	546	-3360	6.9801	-30
2Y	730	-4310	6.8851	-60
3Y	1097	-5840	6.7321	-30
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1886	
CLOSING SPOT RATE			7.3161	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-161.3	-324.3	-894.3	-1511.3	-2150.3
2M		-163	-733	-1350	-1989
3M			-570	-1187	-1826
6M				-617	-1256
9M					-639



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