常规报告系列

收盘日评
银行间外汇衍生品市场

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

【2025-08-28】

今日 Fixing 定在 7.1063，较上一交易日下降了 45 个 bp。今日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-5.6~-5.5 的位置。T/N 主要成交在-21.8~-21.4 的位置。S/N 主要成交在-5.7~-5.6 的位置。1w 成交在-38.5，-38 等位置。2w 成交在-75 的位置。3w 成交在-111 的位置。1s 成交在-188.5，-188，-187，-186.5，-186，-185.5 等位置。2s 成交在-310，-308 等位置。3s 成交在-445，-446 等位置。

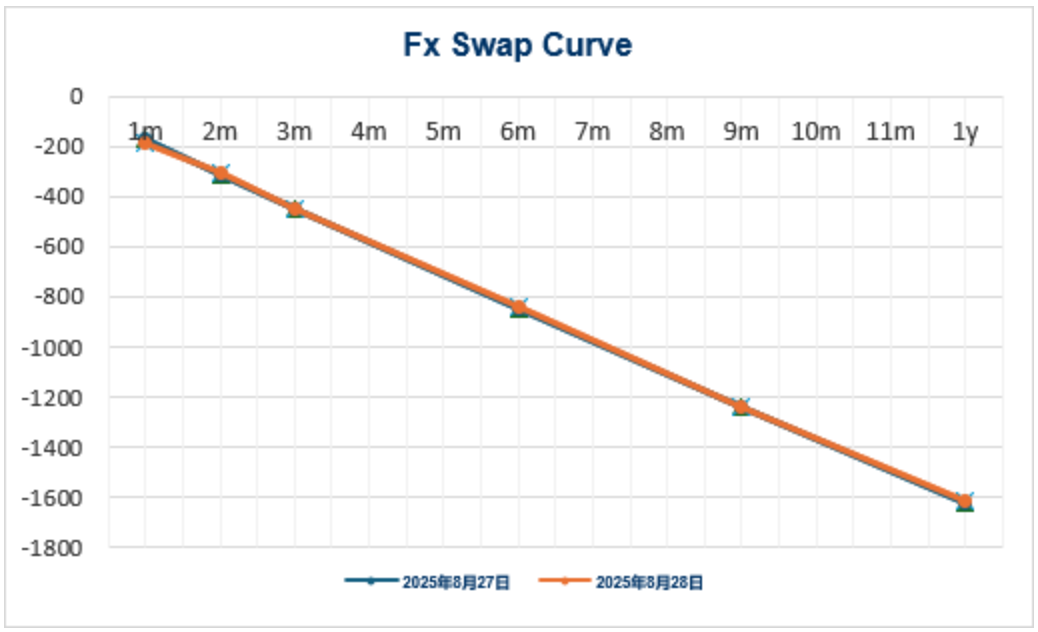
中长期限，6s 成交在-841，-842，-844 等位置。9s 成交在-1238，-1240，-1242 等位置。1y 成交在-1610，-1611，-1608，-1613 等位置。

超长期限，18s 成交在-2175 的位置。

Spread 方面，2w*3w 成交在-36 的位置。6*9s 成交在-397，-398，-399 的位置。6*12s 成交在-770 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	**7**	-38	7.1347	-1.1
2W	**14**	-75	7.1310	-1
1M	**37**	-186	7.1200	-18.3
2M	**62**	-308	7.1077	10
3M	**91**	-446	7.0939	4.5
6M	**181**	-844	7.0541	6
9M	**273**	-1243	7.0142	-4
1Y	**365**	-1614	6.9771	6
18M	**546**	-2180	6.9205	10
2Y	**730**	-2695	6.8690	5
3Y	**1099**	-3720	6.7665	30
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1063	
CLOSING SPOT RATE			7.1385	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	**3M**	**6M**	**9M**	**1Y**
1M	-122.4	-260.5	-658.5	-1057.5	-1428.49
2M		-138.1	-536.1	-935.1	-1306.09
3M			-398	-797	-1167.99
6M				-399	-769.99
9M					-370.99



文 / Yiff Wang

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

免责声明：本日评由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用日评内容。日评所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，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，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本日评任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。