



【2025-01-21】

今日美元/人民币中间价报 7.1703，较上一个交易日下调 183bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-5.35~-5.2；T/N 成交在-5.28~-5.2；S/N 成交在-5.35~-5.26。

1w 成交在-69， -68.5； 2w 成交在-74， -73.8； 3w 成交在-109.5， -109； 1s 成交在-166， -165， -166.5， -168； 2s 成交在-320； 3s 成交在-494， -492， -491， -490。

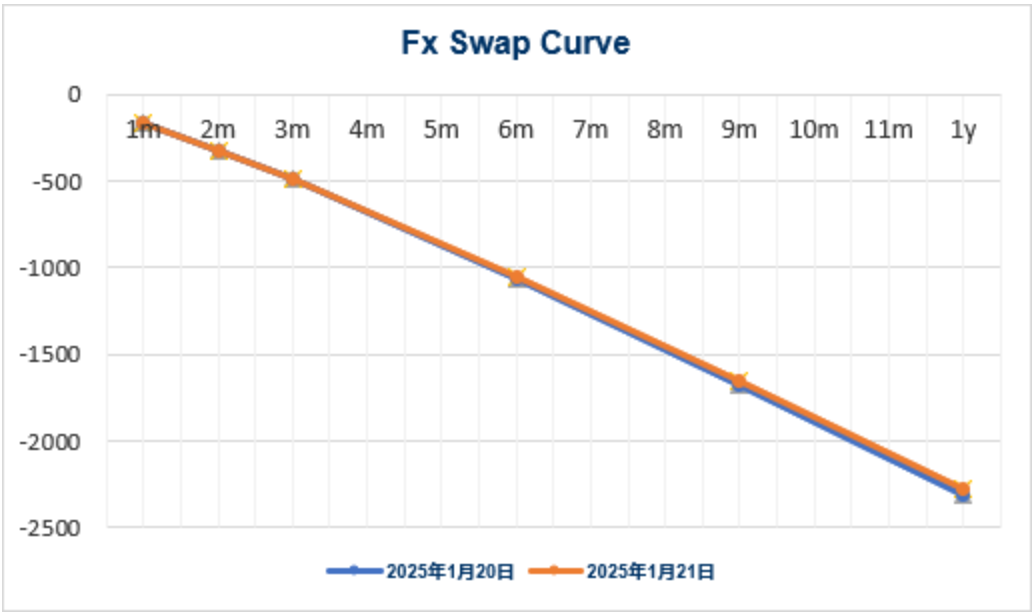
中长期限，6s 成交在-； 9s 成交在-1655； 1Y 成交在-2280， -2265， -2270， -2250 后面又给到-2265， -2266， -2274， 最后收在-2280 附近。

超长期限，18s 成交在-3280。

Spread 方面， 1w*2w 成交在-5.1,-5； 2w*3w 成交在-35.4； 1s*2s 成交在-155； 3s*1y 成交在-1780； 3s*6s 成交在-560； 6s*1y 成交在-1220。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	13	-69	7.2729	-1
2W	14	-74	7.2724	-6
1M	32	-169	7.2629	-3.2
2M	60	-323	7.2475	4
3M	90	-492	7.2306	-2
6M	181	-1055	7.1743	5
9M	273	-1657	7.1141	20
1Y	365	-2278	7.0521	39
18M	546	-3300	6.9498	60
2Y	732	-4100	6.8698	210
3Y	1096	-5785	6.7013	55
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1703	
CLOSING SPOT RATE			7.2798	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-154.1	-323.1	-886.1	-1488.1	-2108.6
2M		-169	-732	-1334	-1954.5
3M			-563	-1165	-1785.5
6M				-602	-1222.5
9M					-620.5



文 / Edison Zeng

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