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

【2025-09-09】

今日美元/人民币中间价报 7.1008，较上一个交易日上调 21bp，全天掉期市场较为活跃。

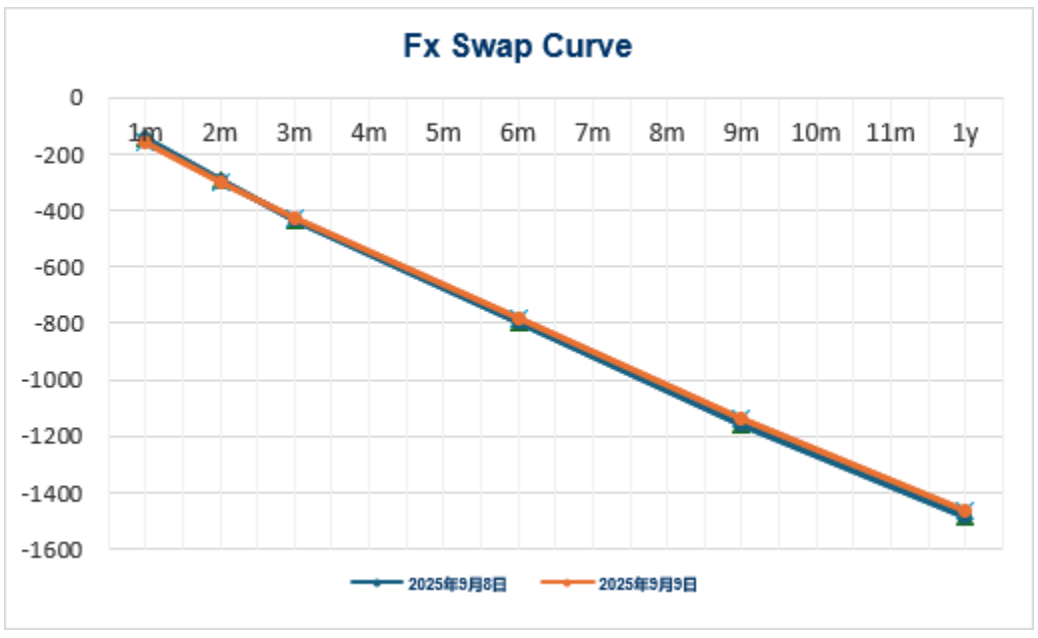
O/N 成交在-5.9~-5.6；T/N 成交在-5.9~-5.7； S/N 成交在-5.73； 1w 成交在-39.8~-39.7； 2w 成交在-77.35，-77.3；1s 成交在-161.5，-161； 2s 成交在-298；3s 成交在-433。

中长期限，9s 成交在-1148；1y 成交在-1477。

Spread 方面，1w*2w 成交在-37.4；3s*6s 成交在-359，-357，-355。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	**7**	-40	7.1208	0.62
2W	**14**	-77	7.1171	1
1M	**33**	-161	7.1087	-14
2M	**62**	-299	7.0950	-4
3M	**91**	-429	7.0819	4.8
6M	**181**	-783	7.0465	12
9M	**273**	-1140	7.0108	22
1Y	**365**	-1462	6.9786	23
18M	**546**	-1972	6.9276	28
2Y	**732**	-2465	6.8783	35
3Y	**1096**	-3485	6.7763	-10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1008	
CLOSING SPOT RATE			7.1248	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	**3M**	**6M**	**9M**	**1Y**
1M	-137.5	-268	-622	-979	-1301
2M		-130.5	-484.5	-841.5	-1163.5
3M			-354	-711	-1033
6M				-357	-679
9M					-322



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

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。