

收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列

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

【2025-01-03】

今日 Fixing 定在 7.1878，较上一交易日下调了 1 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上涨。

短端，O/N 成交在-12.6~-12。T/N 成交在-4.1~-3.8。S/N 成交在-4.25~-3.8。1w 成交在-33~-32.5。2w 成交在-68~-66。1s 成交在-153~-150。2s 成交在-312~-309。3s 成交在-495~-489。

中长期，6s 成交在-1080~-1062。9s 成交在-1725~-1710。1y 成交在-2397~-2340，尾盘收在-2335。

长期限上，18s 成交-3450。2y 成交在-4390。3y 成交在-5990。

Spread 上，1w*2w -34~-35。1*3 成交在-340.5。2*3s 成交在-182。9*12s 成交在-645。6*12s 成交在-1300。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	7.3060	0.15
2W	14	-66	7.3027	8
1M	31	-151	7.2942	7
2M	59	-310	7.2783	2
3M	90	-494	7.2599	7
6M	181	-1070	7.2023	10
9M	275	-1713	7.1380	47
1Y	365	-2346	7.0747	54
18M	546	-3500	6.9593	50
2Y	730	-4400	6.8693	100
3Y	1095	-6100	6.6993	30
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1878	
CLOSING SPOT RATE			7.3093	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-159	-343	-919	-1562	-2195
2M		-184	-760	-1403	-2036
3M			-576	-1219	-1852
6M				-643	-1276
9M					-633

