



【2025-02-14】

今日 Fixing 定在 7.1706，较上一交易日下调了 13 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上升。

短端，O/N 成交在-19.5~-17.7。S/N 成交在-4.9~-4.65。1w 成交在-34.35~-34。1s 成交在-139.5。2s 成交在-303.5。3s 成交在-478~-475。

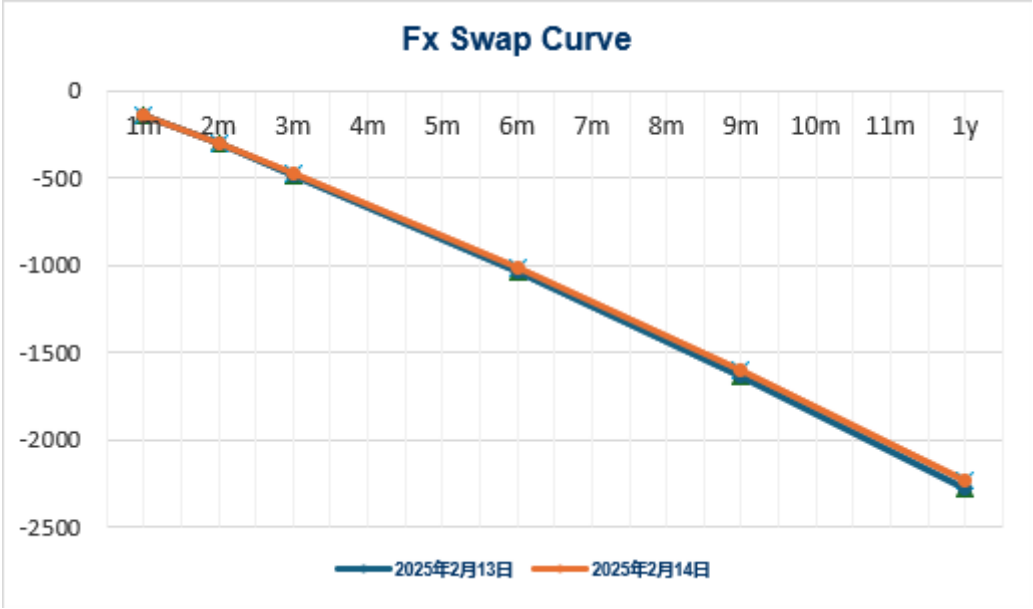
中长期限，6s 成交在-1019~-1013。9s 成交在-1605~-1598。1y 成交在-2250~-2220，尾盘收在-2230。

长期限上，18s 成交在-3240~-3210。

Spread 上，3*6s 成交在-542~-540。6*12s 成交在-1225~-1215。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-34	7.2620	0.62
2W	14	-71	7.2583	-1
1M	28	-140	7.2514	0
2M	59	-304	7.2350	4
3M	90	-477	7.2177	6
6M	181	-1017	7.1637	15
9M	273	-1605	7.1049	28
1Y	371	-2236	7.0418	46
18M	546	-3235	6.9419	65
2Y	730	-4175	6.8479	115
3Y	1095	-5715	6.6939	135
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1706	
CLOSING SPOT RATE			7.2654	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-164	-337	-877	-1465	-2096
2M		-173	-713	-1301	-1932
3M			-540	-1128	-1759
6M				-588	-1219
9M					-631



文 / Jason Ge

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。