

收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列



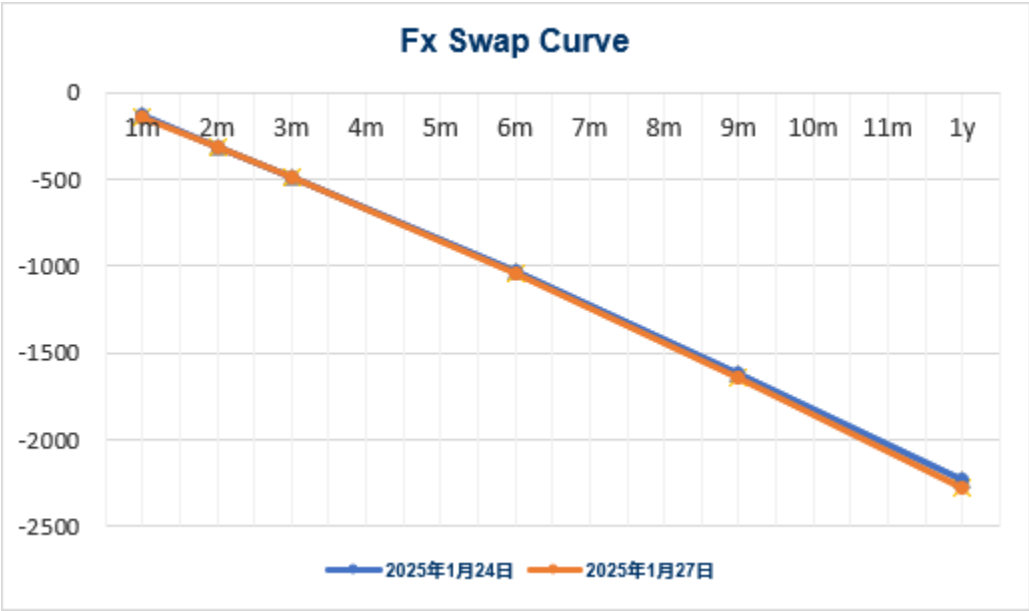
【2025-01-27】

今日美元/人民币中间价报 7.1698，较上一个交易日下调 7bp，各期限收盘价较上一交易日有所下行。ON 成交在-48~-32；TN 成交在-5~-4.6；SN 成交在 -5.1~-4.95 之间。3w 成交在 -106.5 的位置；1S 反复成交在 -141~-140 之间 3s 成交在-485 的位置；中长期，6s 成交在 -1050，-1046 尾盘收在 -1046 附近；9S 成交在-1640，-1638 尾盘收在-1639 附近；1Y 从 成交在-2280，-2275，-2270；尾盘收在 -2275。Spread 方面，3w*1s 成交在-34.5 的位置；6s*1y 成交在-1235，-1233 的位置；9s*1y 成交在-638 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward (Mid)	Δ SWAP PIPS
1W	7	-36	7.2614	0.92
2W	14	-72	7.2578	-5
1M	28	-141	7.2509	-8
2M	60	-317	7.2333	1
3M	89	-485	7.2165	2.5
6M	181	-1046	7.1604	-20

9M	273	-1639	7.1011	-16
1Y	365	-2275	7.0375	-41
18M	546	-3240	6.9410	30
2Y	740	-4285	6.8365	-125
3Y	1096	-5800	6.6850	-100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1698	
CLOSING SPOT RATE			7.2650	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-176	-344	-905	-1498	-2134
2M		-168	-729	-1322	-1958
3M			-561	-1154	-1790
6M				-593	-1229
9M					-636



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