

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

【2025-01-02】

今日 Fixing 定在 7.1879, 较上一交易日下降了 5 个 bp。今日各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端, O/N 主要成交在-5~-4.3。 T/N 主要成交在-12~-10.8 的位置。 S/N 主要成交在-4.8~-4.4 的位置。 1w 成交在-34, -33.5 等位置。 2w 成交在-75 的位置。 1s 成交在-161, -160, -159, -158.5, -158 等位置。 2s 成交在-320, -318, -315, -314, -313 等位置。 3s 成交在-506, -510, -513, -512, -505, -503 等位置。

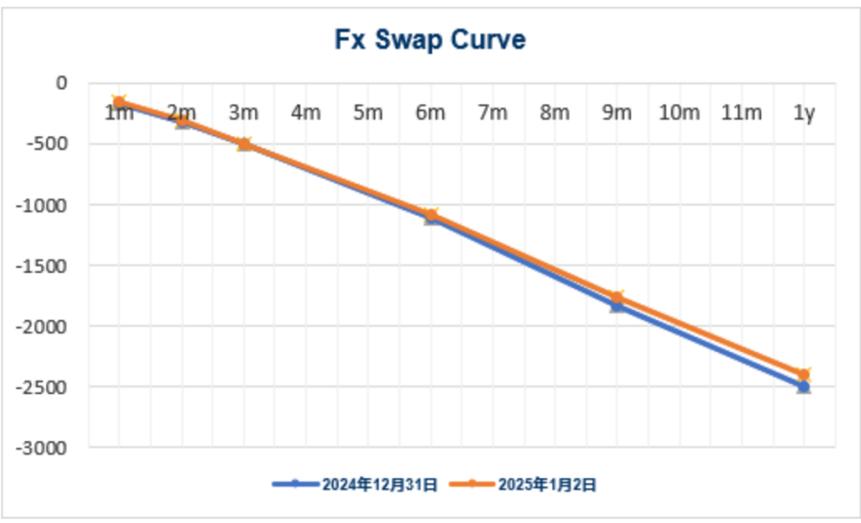
中长期, 6s 成交在-1115, -1113, -1112, -1105, -1100, -1090, -1085 等位置。 9s 成交在-1815, -1810, -1803, -1795, -1780, -1765, -1760 等位置。 1y 成交在-2485, -2475, -2465, -2452, -2450, -2430, -2420 等位置。

超长期, 2y 成交在-4560 的位置。 3y 成交在-6130 的位置。

Spread 方面, 1w*1s 成交在-127 的位置, 1*2s 成交在-155 的位置, 6*9s 成交在-688 的位置。 9*12s 成交在-668, -663, -656 的位置。 6*12s 成交在-1356, -1352 的位置。 2*3y 成交在-1620 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	7.2961	1.96
2W	15	-74	7.2920	-2
1M	31	-158	7.2836	10.6
2M	59	-312	7.2682	6
3M	91	-501	7.2493	2
6M	182	-1080	7.1914	31
9M	276	-1760	7.1234	66
1Y	365	-2400	7.0594	98
18M	546	-3550	6.9444	90
2Y	730	-4500	6.8494	120
3Y	1095	-6130	6.6864	70
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1879	
CLOSING SPOT RATE			7.2994	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-154	-343	-922	-1602	-2242
2M		-189	-768	-1448	-2088
3M			-579	-1259	-1899
6M				-680	-1320
9M					-640



文 / Yiff Wang

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