

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

【2025-02-24】

今日美元/人民币中间价报 7.1717，较上一个交易日上调 21bp，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

ON 成交在 -4.8~-4.1；TN 成交在 -4.79~-4.55；SN 成交在 -4.83~-4.75 之间。

1w 成交在 -33.7, -33.6, -33.5 的位置；1S 反复成交在 -139.5~-138 之间；2s 成交在 -307.5, -306.5, -305, -303.5, -301 的位置；3s 成交在 -466, -465, -464.5, -464, -463, -461 的位置；

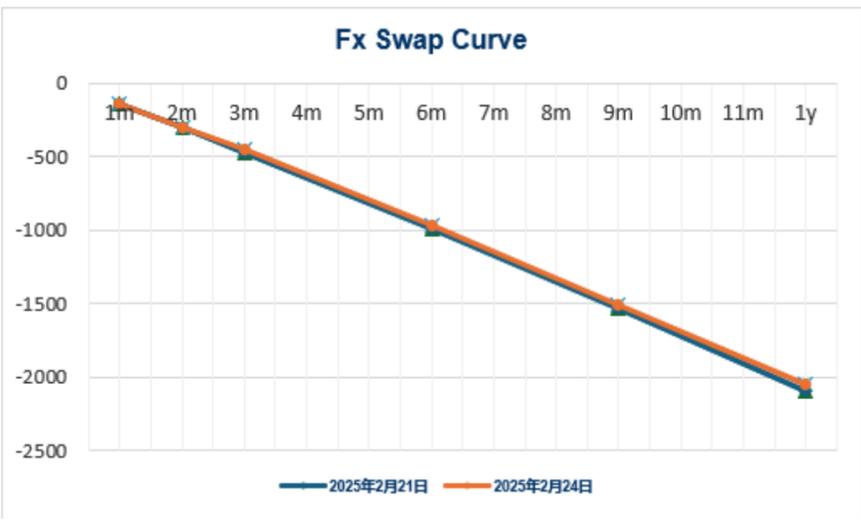
中长期，6s 成交在 -985, -984, -983, -980, -977, -976, -974 附近；9S 成交在 -1519, -1518, -1512, -1510, -1504, -1499 附近；1Y 成交在 -2075, -2070, -2068, -2067, -2065, -2064, -2063, -2062, -2061, -2060, -2055, -2050, -2047, -2045, -2040, -2035 的位置；

超长期限，18s 成交在-3000 的位置；

Spread 方面，1s*2s 成交在 -166.5 的位置；6s*9s 成交在 -533 的位置；6s*1y 成交在-1084 的位置；18s*2y 成交在-870, -865 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-34	7.2450	-0.5
2W	14	-68	7.2416	0
1M	28	-138	7.2346	2
2M	61	-300	7.2184	-2
3M	90	-454	7.2030	17
6M	181	-971	7.1513	16
9M	273	-1513	7.0971	21
1Y	365	-2054	7.0430	36
18M	546	-3005	6.9479	25
2Y	730	-3860	6.8624	55
3Y	1097	-5450	6.7034	135
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1717	
CLOSING SPOT RATE			7.2484	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-162	-316	-833	-1375	-1916
2M		-154	-671	-1213	-1754
3M			-517	-1059	-1600
6M				-542	-1083
9M					-541



文 / Ray Yan

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。