



【2025-01-08】

今日 Fixing 定在 7.1887，较上一交易日上升了 8 个 bp。今日各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 主要成交在-6.5~-4.5。 T/N 主要成交在-6.2~-3.85 的位置。S/N 主要成交在-18~-13 的位置。1w 成交在-32， -33， -35， -37， -37.5， -38， -40 等位置。2w 成交在-67， -70， -73， -74 的位置。3w 成交在-132， -133.5， -135 等位置。1s 成交在-153， -155， -1580， -160， -161， -162， -163.5 等位置。2s 成交在-315， -318， -320， -322 等位置。3s 成交在-492， -495， -498， -500， -503， -505， -508 等位置。

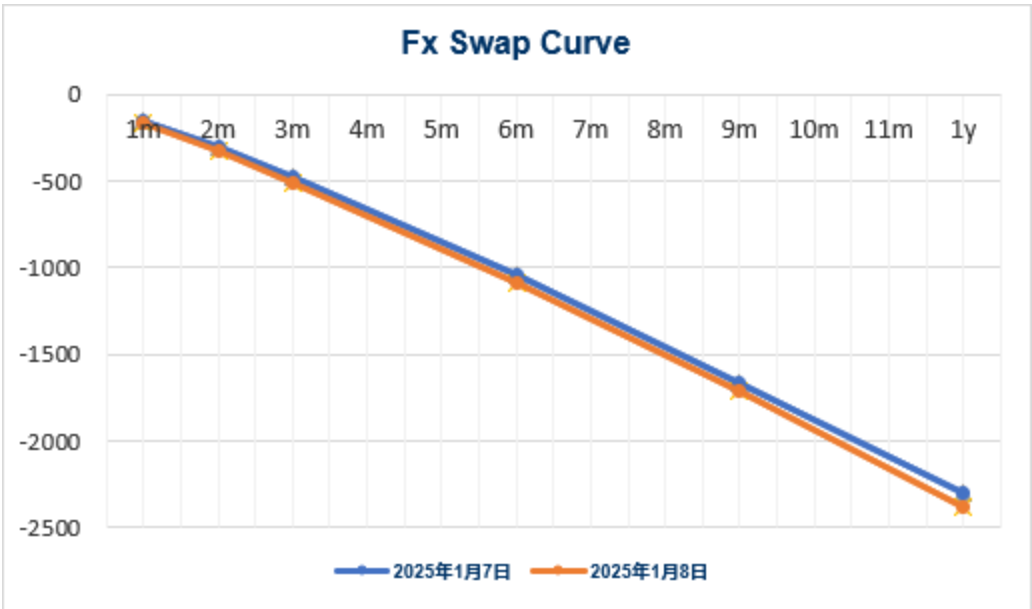
中长期限，6s 成交在-1060， -1066， -1070， -1075， -1080， -1082， -1083， -1088 等位置。9s 成交在-1680， -1695， -1700， -1705， -1710 等位置。1y 成交在-2340， -2345， -2348， -2350， -2358， -2356， -2360， -2364， -2370， -2375 等位置。

超长期限，18s 成交在-3430 的位置。2y 成交在-4370， -4400 的位置。3y 成交在-6036， -6040， -6030 等位置。

Spread 方面，2*3w 成交在-60 的位置， 6*12s 成交在-1272， -1280 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.3277	-11.1
2W	14	-74	7.3243	-16
1M	26	-163	7.3154	-12.6
2M	59	-322	7.2995	-15
3M	90	-508	7.2809	-26
6M	181	-1088	7.2229	-46
9M	273	-1714	7.1603	-47.5
1Y	367	-2377	7.0940	-80
18M	546	-3450	6.9867	-60
2Y	731	-4395	6.8922	5
3Y	1095	-6036	6.7281	-86
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1887	
CLOSING SPOT RATE			7.3317	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-158.9	-344.9	-924.9	-1550.9	-2213.9
2M		-186	-766	-1392	-2055
3M			-580	-1206	-1869
6M				-626	-1289
9M					-663



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