

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

【2025-01-16】

今日 Fixing 定在 7.1881，较上一交易日下降了 2 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-4~-2。T/N 主要成交在-18~-12 的位置。S/N 主要成交在-5~-4.2 的位置。2w 成交在-66，-66.5 的位置。3w 成交在-95，-96 等位置。1s 成交在-150.5，-150，-148.5，-149，-149.3，-150.5 等位置。2s 成交在-302 等位置。3s 成交在-477，-478，-478.5，-480 等位置。4s 成交在-658 的位置。

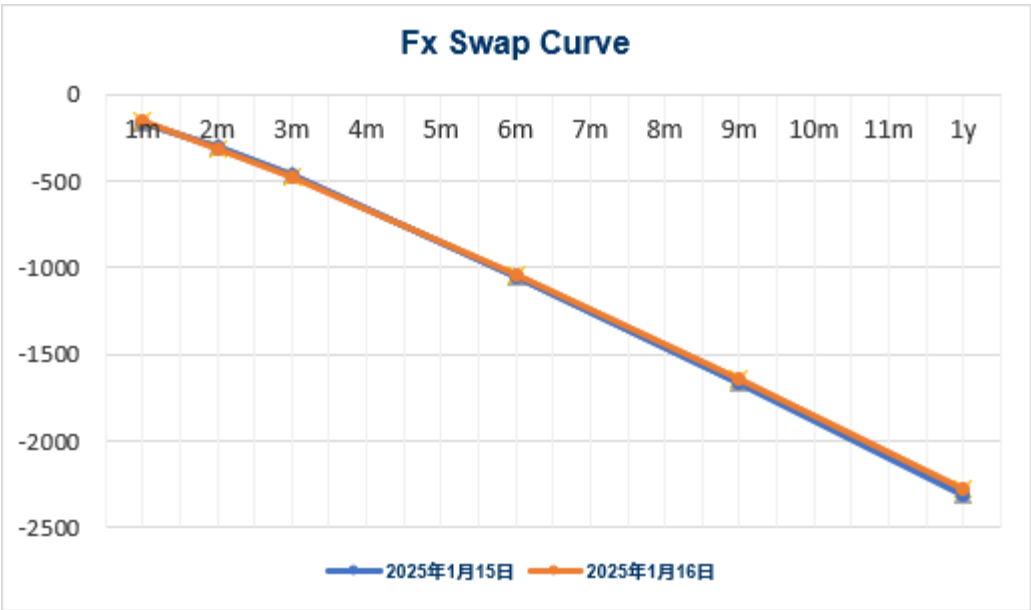
中长期限，6s 成交在-1039，-1038，-1040 等位置。9s 成交在-1645，-1636，-1640 等位置。1y 成交在-2265，-2260，-2270，-2272，-2275，-2277，-2280，-2278，-2279，-2277 等位置。

Spread 方面，2*3w 成交在-29 的位置。6*12s 成交在-1235 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	15	-67	7.3250	-33.51
2W	15	-67	7.3250	26
1M	31	-151	7.3167	9.5
2M	59	-310	7.3007	-2

3M	90	-480	7.2837	-10
6M	181	-1040	7.2278	11
9M	273	-1645	7.1672	15
1Y	365	-2277	7.1040	39
18M	546	-3315	7.0002	15
2Y	730	-4250	6.9067	30
3Y	1095	-5825	6.7492	35
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1881	
CLOSING SPOT RATE			7.3317	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-159.5	-329.5	-889	-1494.5	-2126.5
2M		-170	-729.5	-1335	-1967
3M			-559.5	-1165	-1797
6M				-605.5	-1237.5
9M					-632



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:

以上所登及附加的所有信息（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