

收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列



【2025-01-14】

今日美元/人民币中间价报 7.1878，较上一个交易日下调 7bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-4.8~4；T/N 成交在-5~4.5；S/N 成交在-4.96~-4.7。

1w 成交在-34.5；3w 成交在-103.7， -103；1s 成交在-165， -163， -162；2s 成交在-316；3s 成交在-493， -489， -490。

中长期限，6s 成交在-1050， -1048， -1047， -1045；9s 成交在-1660；1Y 成交在-2283， -2280， -2279， 后面又给到-2285， -2286， 最后收在-2293 附近。

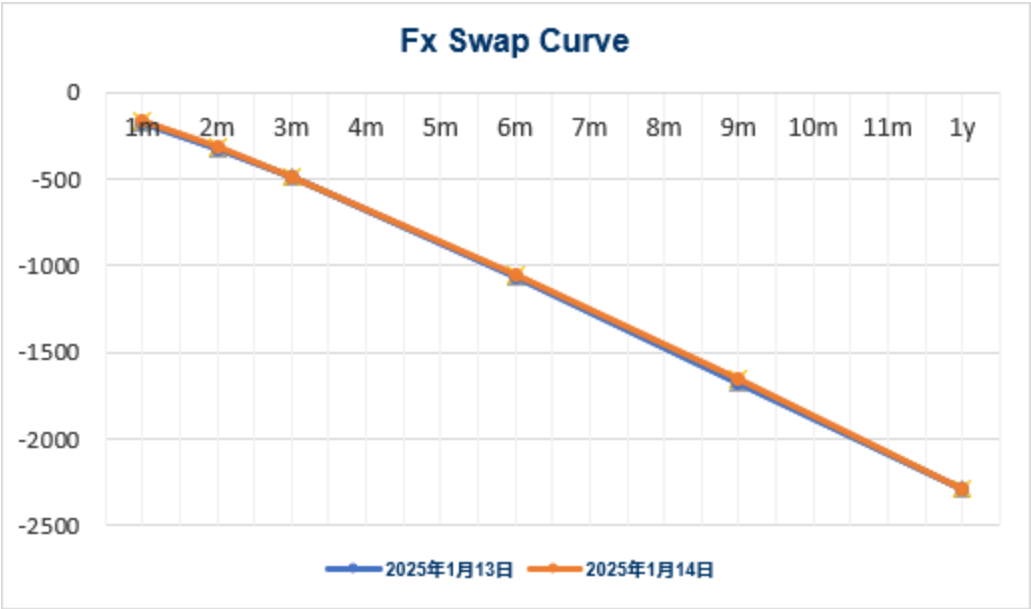
超长期限，3y 成交在-5850；

Spread 方面， 3s*6s 成交在-557； 6s*1y 成交在-1235。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-34	7.3269	2.55
2W	20	-98	7.3205	9

1M	21	-165	7.3138	9.5
2M	60	-315	7.2988	13
3M	90	-491	7.2813	2.5
6M	181	-1049	7.2254	11
9M	273	-1656	7.1647	19
1Y	365	-2290	7.1013	0
18M	546	-3315	6.9988	35
2Y	733	-4290	6.9013	10
3Y	1097	-5850	6.7453	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1878	
CLOSING SPOT RATE			7.3303	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-149.7	-325.2	-883.7	-1490.7	-2124.7
2M		-175.5	-734	-1341	-1975
3M			-558.5	-1165.5	-1799.5
6M				-607	-1241
9M					-634



文 / Edison Zeng

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