



【2025-01-22】

今日美元/人民币中间价报 7.1696，较上一个交易日下调 7bp，各期限收盘价较上一交易日略微下行。

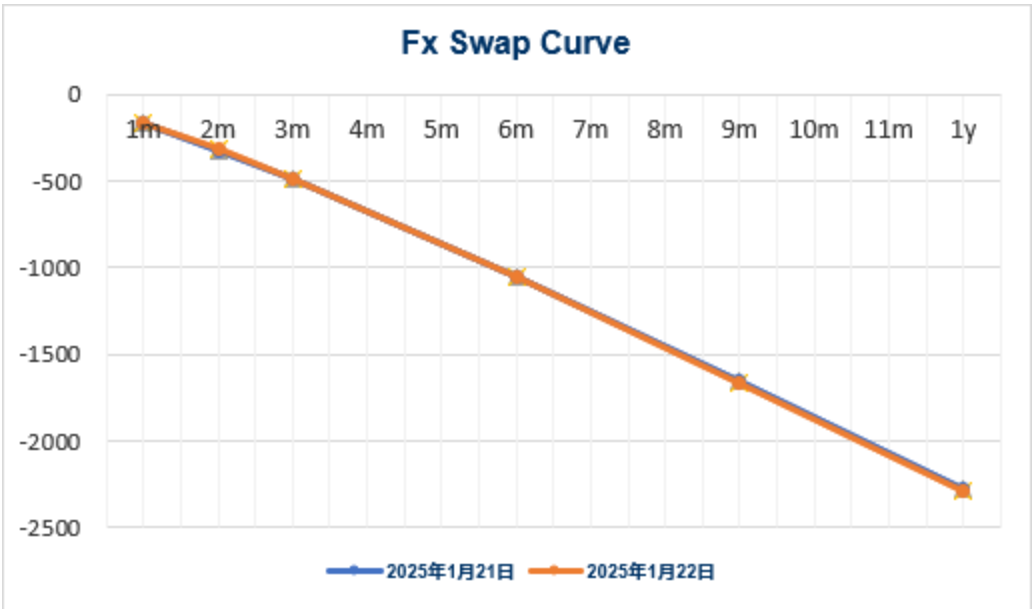
ON 从-5.2 买到-5.1、-5，午后给到-5.5；TN 早盘成交在-5.5、-5.6，午后买到-5.4、-5.3、-5.2、-5.17、-5.1；SN 成交在-16.85、-16.8、-16.9。1W 成交在-65.8~-65.2 之间；2W 成交在一78.73~73.9 附近；3W 成交在-114.5。1S 来回成交在-166~-164 之间；2S 成交在-324.05~-319 附近；3S 反复成交在-498~-493 之间。

中长期限，6S 成交在-1063~-1060 之间，尾盘收在-1055 附近；9S 成交在-1675，尾盘收在-1660 附近；1Y 从-2297 给到-2310、-2316，后买回-2314、-2313、-2290。

Spread 方面，1W\*3W 成交在-48.3，3W\*1S 成交在-51.5，1\*2S 成交在-156，6\*12S 成交在-1247、-1245、-1240。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 12   | -63        | 7.2737       | 6          |
| 2W                      | 14   | -74        | 7.2726       | 0          |
| 1M                      | 31   | -164       | 7.2636       | 4.9        |
| 2M                      | 59   | -319       | 7.2481       | 4          |
| 3M                      | 90   | -493       | 7.2307       | -1         |
| 6M                      | 181  | -1055      | 7.1745       | 0          |
| 9M                      | 273  | -1660      | 7.1140       | -3         |
| 1Y                      | 367  | -2289      | 7.0511       | -12        |
| 18M                     | 546  | -3300      | 6.9500       | 0          |
| 2Y                      | 731  | -4250      | 6.8550       | -150       |
| 3Y                      | 1095 | -5790      | 6.6960       | -55        |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 7.1696       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 7.2800       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |      |      |      |       |       |
|---------------------|------|------|------|-------|-------|
|                     | 2M   | 3M   | 6M   | 9M    | 1Y    |
| 1M                  | -155 | -329 | -891 | -1496 | -2125 |
| 2M                  |      | -174 | -736 | -1341 | -1970 |
| 3M                  |      |      | -562 | -1167 | -1796 |
| 6M                  |      |      |      | -605  | -1234 |
| 9M                  |      |      |      |       | -629  |



文 / Cathy He

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

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。