



【2025-01-07】

今日美元/人民币中间价报 7.1879，较上一个交易日上调 3bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-3.5， -3.45， -3.4； T/N 成交在-4.24~-3.1； S/N 成交在-4.35~-3.08； 1w 成交在-28.99~-27.8； 2w 成交在-57.7； 1s 成交在-152， -150， -151， -147； 2s 成交在-302； 3s 成交在-484， -476.3， -475。

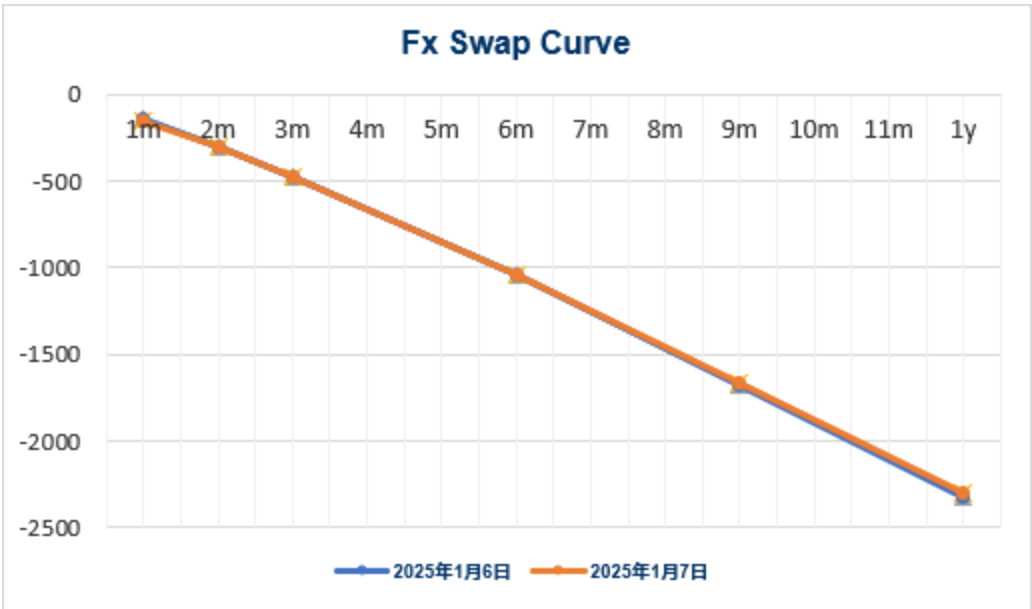
中长期限，6s 成交在-1050， -1044， -1042， -1040； 9s 成交在-1688， -1675， -1670； 1y 开始成交在-2312， -2310， -2306， 后面又给到-2312， -2315， -2333， -2334 后面又买到-2320， -2317， -2314 最后收在-2303 左右。

超长期限，18s 成交在-3390； 3y 成交在-5980， -5950。

Spread 方面，2w*3w 成交在-63.5； 6s*1y 成交在-1270。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-29	7.3246	-2.03
2W	14	-58	7.3217	-3
1M	27	-151	7.3125	-3.5
2M	60	-307	7.2968	-4
3M	90	-482	7.2793	-7
6M	181	-1042	7.2233	1
9M	273	-1667	7.1609	10.5
1Y	365	-2297	7.0978	21
18M	546	-3390	6.9885	-10
2Y	732	-4400	6.8875	-75
3Y	1096	-5950	6.7325	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1879	
CLOSING SPOT RATE			7.3275	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-156.5	-331.5	-891.5	-1516	-2146.5
2M		-175	-735	-1359.5	-1990
3M			-560	-1184.5	-1815
6M				-624.5	-1255
9M					-630.5



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