CHINA FOREIGN EXCHANGE TRADE SYSTEM
中国外汇交易中心
全国银行间同业拆借中心
NATIONAL INTERBANK FUNDING CENTER

CFETS | DATA

中国外汇交易中心
数据信息服务手册

2020.06

中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心（以下简称交易中心）以银行间市场交易平台的报价、成交数据为核心，辅以交易后处理数据、同业存单发行数据、备案数据，同时引入经纪公司等第三方数据等，形成了准确完整的银行间市场数据库，为境内外机构提供中国银行间外汇市场、货币市场、债券市场、衍生品市场等市场的综合数据信息服务。

交易中心的数据信息服务序列：

我们的优势

数据权威

- 数据直接来自交易平台、交易后处理平台、经纪公司等第三方机构，数据完整准确。

时效性强

- 实时更新，及时反映市场情况。

产品丰富

- 拥有市场行情、数据挖掘、基准指标和曲线、产品估值、指数及参考数据等多种数据产品，为用户提供全方位的数据信息服务。

应用广泛

- 产品可应用于交易前台、中台、后台，为用户提供一站式解决方案，让交易投资和风控管理轻松高效。

渠道多元

- 可通过数据接口、交易终端、iData、中国货币网、授权信息商终端/接口等多渠道获取。

市场数据

依托银行间市场交易平台，交易中心可及时准确地向各类用户提供全量高质的银行间市场报价、成交及收盘数据，帮助用户捕捉交易机会、开展市场分析、建立数据模型、进行风险控制、以及搭建前中后台数据直通式处理等业务。

外汇市场行情数据

涵盖银行间人民币外汇和外币对市场的即期、远期、掉期、期权产品，以及外币拆借等银行间外币货币市场产品在不同交易模式下的报价、成交等数据。

外汇市场行情数据包括市场实时数据、分钟快照数据、定点行情数据（如参考汇率）及收盘数据（如人民币兑美元收盘价）。

参考汇率

货币对	10:00	11:00	14:00	15:00	16:00	17:00	18:00	19:00	20:00	21:00	22:00	23:00
USD/CNY	7.1050	7.1039	7.1057	7.1025	7.0993	7.0976	7.1023	7.1051	7.1048	7.1055	7.1072	7.1145
EUR/CNY	7.7878	7.7883	7.7840	7.7890	7.7860							
100JPY/CNY	6.5989	6.5995	6.5993	6.5925	6.5863							
GBP/CNY	8.6670	8.6671	8.6605	8.6658	8.6544							

数据获取渠道

- CMDS数据接口
- CMDS Pro高速数据接口
- 交易终端
- 中国货币网
- 授权信息商终端

本币市场行情数据

涵盖银行间人民币市场信用拆借、质押式回购、买断式回购、现券买卖、债券借贷、利率互换、债券远期、利率期权等各类市场的报价、成交等市场行情。

本币市场行情数据包括市场实时数据、分钟快照及收盘数据。

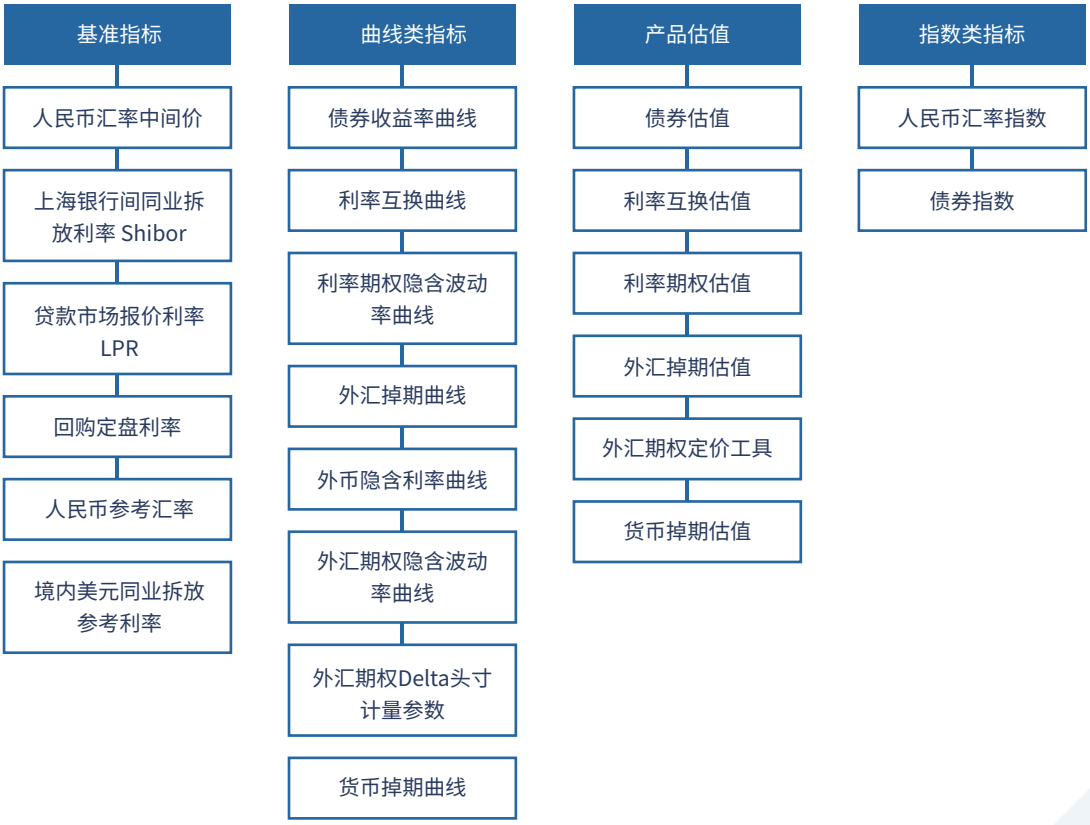
数据获取渠道

- CMDS数据接口
- 交易终端
- 中国货币网
- 授权信息商终端

基准数据

交易中心自1999年开始研发债券定价基准，经过20年的发展，现已有效覆盖银行间外汇市场、货币市场、债券市场、衍生品市场等各核心要素市场，形成基准指标、曲线类指标、产品估值、指数类指标等四大系列22类基准产品。

这些指标被广泛应用于产品定价、盯市估值、交易分析、业绩比较和风险管理等多个领域，成为我国外汇市场、货币市场、债券市场、信贷市场和衍生品市场的重要参考基准。



基准指标

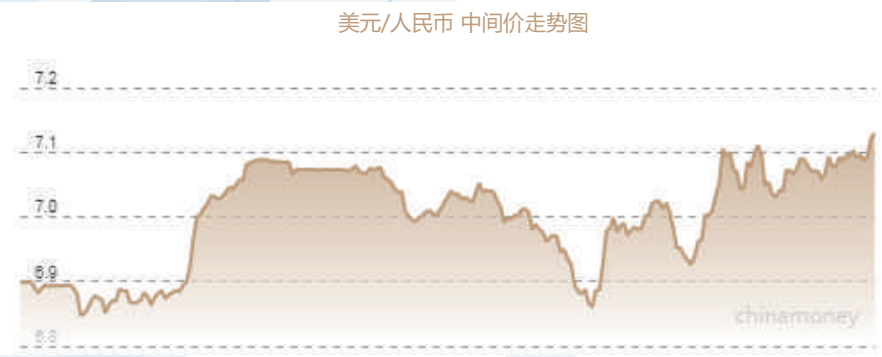
交易中心致力于人民币及相关产品定价中心建设，计算和发布人民币汇率中间价、上海银行间同业拆放利率（Shibor）、贷款市场报价利率(LPR)、人民币参考汇率、回购定盘利率、境内美元同业拆放参考利率(USD CIROR)等汇率、利率基准。

人民币汇率中间价

交易中心根据中国人民银行授权，于每个交易日上午9:15，计算并发布人民币对美元等国际主要货币的汇率中间价。人民币汇率中间价是当日银行间外汇市场及银行柜台交易的价格基准。

美元/人民币	7.1293	84.00 ▲	欧元/人民币	7.7703	50.00 ▲
100日元/人民币	6.6181	92.00 ▲	港元/人民币	0.91958	14.90 ▲
英镑/人民币	8.6951	166.00 ▲	澳元/人民币	4.6638	45.00 ▲
新西兰元/人民币	4.3466	38.00 ▲	新加坡元/人民币	5.0046	51.00 ▲
瑞士法郎/人民币	7.3383	65.00 ▲	加元/人民币	5.1003	90.00 ▲
人民币/马来西亚林吉特	0.61175	7.30 ▼	人民币/俄罗斯卢布	10.0407	58.00 ▲
人民币/南非兰特	2.4743	31.00 ▲	人民币/韩元	174.03	19.00 ▲

美元/人民币 中间价走势图

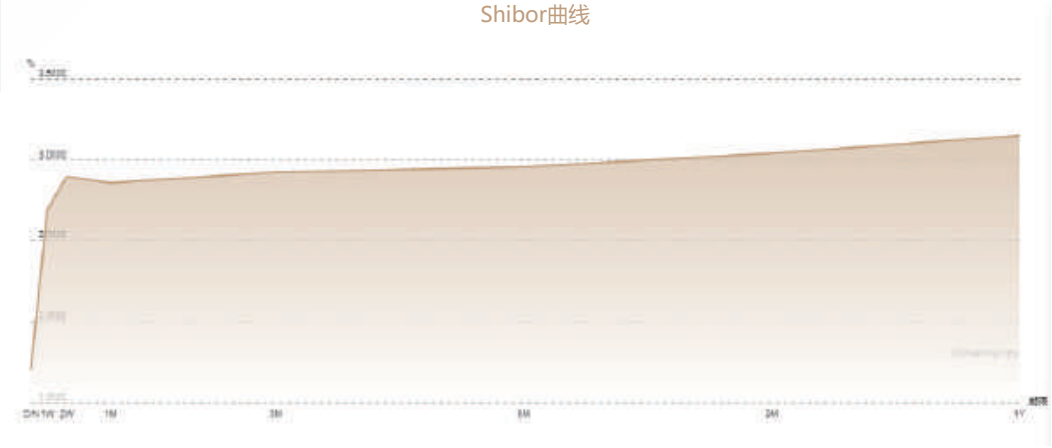


上海银行间同业拆放利率(Shibor)

由信用等级较高的银行组成报价团自主报出的人民币同业拆出利率计算确定的算术平均利率，属单利、无担保、批发性利率。在浮动利率债券、衍生产品定价、商业银行内部转移定价等方面发挥重要的基准作用。

O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
1.7000	2.6910	2.8950	2.8570	2.9230	2.9550	3.0400	3.1470

Shibor曲线



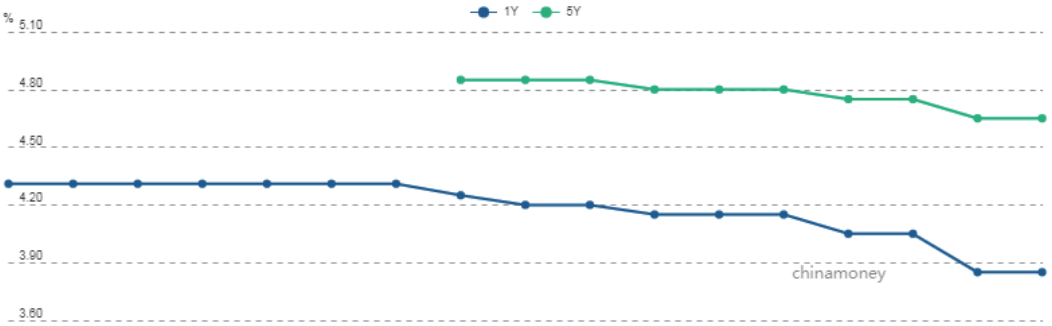
贷款市场报价利率(LPR)

由各报价行按公开市场操作利率（主要指中期借贷便利利率）加点形成的方式报价，由全国银行间同业拆借中心计算得出，为银行贷款提供定价参考。目前，贷款市场报价利率包括1年期和5年期以上两个品种。

贷款市场报价利率(LPR)

期限	LPR(%)
1Y	3.85
5Y	4.65

LPR品种历史走势图



回购定盘利率

以银行间质押式回购交易利率为基础计算而得的具有基准性质的市场利率，包括回购定盘利率和银银间回购定盘利率两大系列。回购定盘利率现已广泛应用于利率互换、货币掉期等衍生品利率标的。

人民币参考汇率

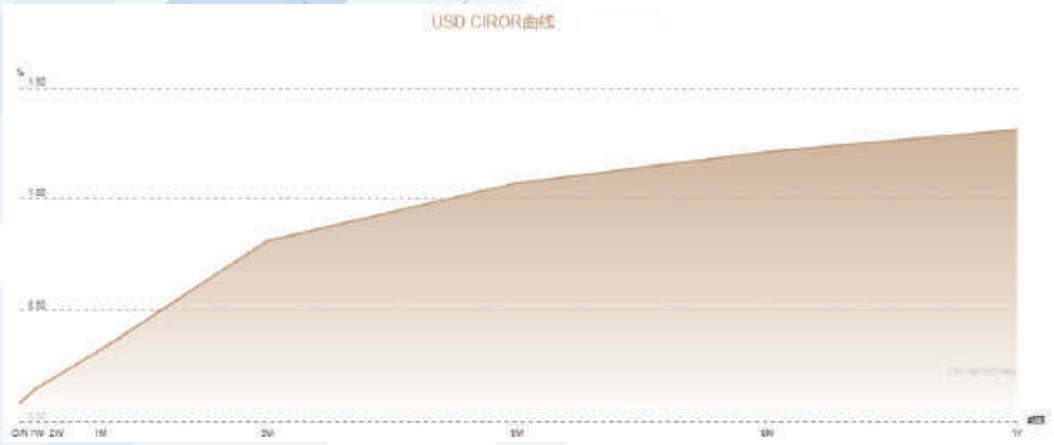
为便于有关主体了解未在交易中心挂牌交易货币对人民币的折算汇率情况，交易中心计算并公布人民币参考汇率。该汇率每月最后一个交易日更新，仅供参考使用。

货币名称	货币代码	货币对简称	人民币参考汇率	货币名称	货币代码	货币对简称	人民币参考汇率
阿尔巴尼亚列克	ALL	CNY/ALL	16.114	安哥拉宽扎	AOA	CNY/AOA	79.509
阿根廷比索	ARS	CNY/ARS	9.4486	波黑马克	BAM	CNY/BAM	0.25767
保加利亚列维	BGN	CNY/BGN	0.25514	巴林第纳尔	BHD	CNY/BHD	0.053577
文莱元	BND	CNY/BND	0.20010	玻利维亚诺	BOB	CNY/BOB	0.97703
巴西雷亚尔	BRL	CNY/BRL	0.75613	博茨瓦纳普拉	BWP	CNY/BWP	1.7114
白俄罗斯卢布	BYN	CNY/BYN	0.34475	智利比索	CLP	CNY/CLP	118.21

境内美元同业拆放参考利率(USD CIROR)

由交易中心根据境内信用等级较高、外币定价能力较强、外币拆借交易相对活跃的银行报价计算并发布的以单利计息、无担保、批发性的拆出利率。目前公布的CIROR币种为美元，品种包括隔夜、1周、2周、1个月、3个月、6个月、9个月及1年。

O/N	1W	2W	1M	3M	6M	9M	1Y
0.08	0.15	0.20	0.32	0.81	1.07	1.21	1.31



曲线类指标

基于银行间本外币交易平台的实时成交、报价及经纪公司报价等有效价格信息，交易中心编制各类曲线及计量参数，为机构金融产品的交易、定价和风险计量提供了参考基准。

曲线类指标包括债券收益率曲线、利率互换曲线、利率期权隐含波动率曲线、外汇掉期曲线、外币隐含利率曲线、外汇期权隐含波动率曲线、外汇期权Delta头寸计量参数、货币掉期曲线等。

债券收益率曲线

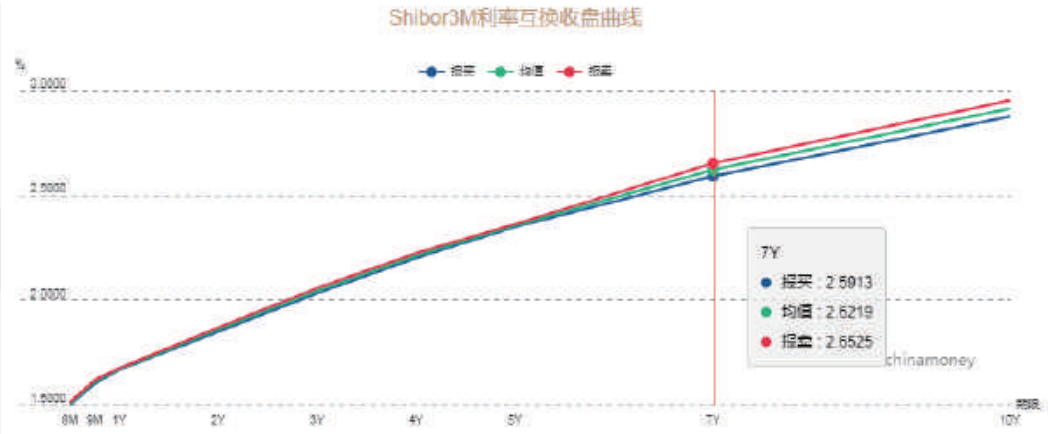
交易中心目前已形成比较完整的债券收益率曲线系列，每日发布68条债券收盘收益率曲线，包括4条利率债曲线、55条信用债曲线、9条同业存单曲线。该曲线系列基本覆盖银行间债券市场主要债券种类和信用评级，提供到期、即期及远期曲线，共计204条曲线。

交易中心债券收盘收益率曲线族谱图
利率债
央行票据
国债
政策性金融债(进出口行、农发行)
政策性金融债(国开行)
中期票据
中期票据(AA)
中期票据(AA+)
中期票据(AAA-)
中期票据(AAA)
中期票据(AAA+)
中期票据(A)
中期票据(AA+)
中期票据(AA-)
短期融资券
短期融资券(AA)
短期融资券(AA+)
短期融资券(AAA-)
短期融资券(AAA)
短期融资券(AAA+)
短期融资券(A-)
短期融资券(A)
短期融资券(A+)
短期融资券(AA-)
超短期融资券
超短期融资券(AAA)
超短期融资券(AAA+)
企业债
企业债(AA+2)
企业债(AA+)
企业债(AAA2)
企业债(AAA-)
企业债(AAA)
企业债(AAA+)
企业债(A)
企业债(A+)
企业债(AA-2)
企业债(AA-)
企业债(AA2)
企业债(AA)
企业债(A-)
其他信用债
政府地方债(AAA-)
政府地方债(AAA)
政府支持机构债券(减税)
政府支持机构债券
同业存单
同业存单(AAA-)
同业存单(AAA)
同业存单(AAA+)
同业存单(A-)
同业存单(A)
同业存单(A+)
商业银行普通金融债
商业银行普通金融债(AA+)
商业银行普通金融债(AA+)
商业银行普通金融债(AA+)
商业银行普通金融债(AAA)
商业银行普通金融债(AA+)
商业银行普通金融债(AA+)
国际开发机构债
国际开发机构债
浮息债
中期票据(1Y-Depo,AA-)点差
中期票据(1Y-Depo,AA)点差
中期票据(1Y-Depo,AA+)点差
中期票据(1Y-Depo,AAA)点差
企业债(Shibor_1Y,AA+)点差
企业债(1Y-Depo,AAA)点差
企业债(Shibor_3M,AAA)点差
政策性金融债(Shibor_3M)点差
政策性金融债(1Y-Depo)点差

利率互换曲线

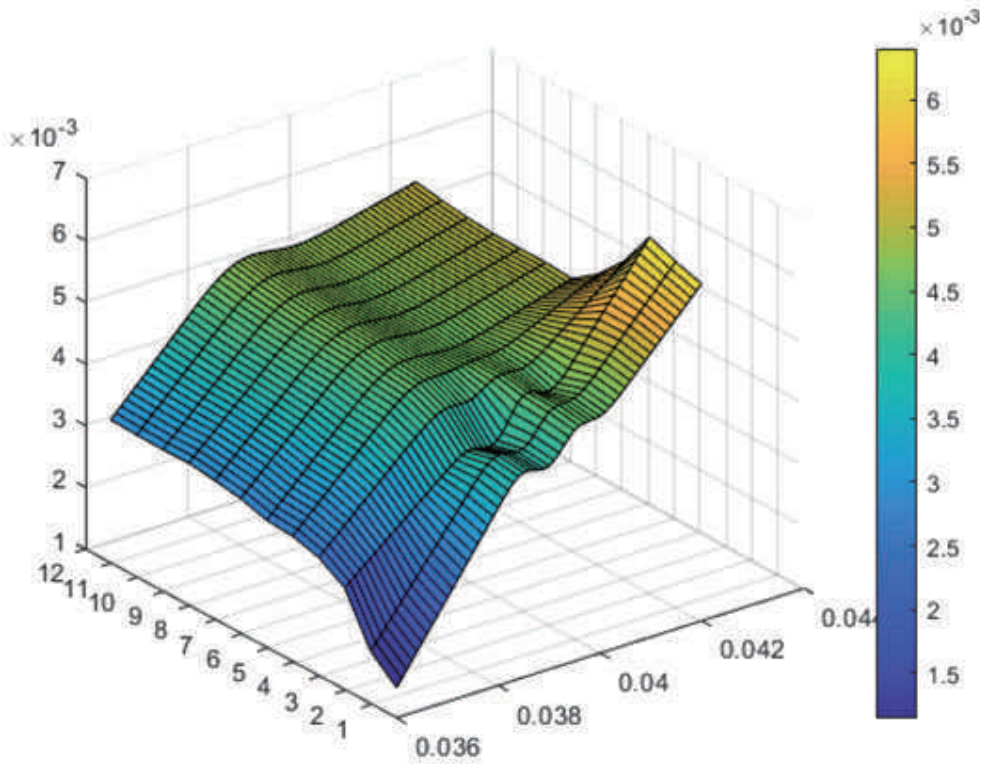
利率互换曲线分为利率互换定盘、收盘和行情曲线，曲线种类包括Shibor3M、ShiborO/N、FR007、FDR007、LPR1Y（季付）及LPR5Y（季付）。其中，Shibor3M和FR007利率互换曲线包括利率互换定盘、收盘和行情曲线，其余品种仅包括利率互换定盘和收盘曲线。

交易中心每个工作日12:10发布当日利率互换定盘曲线，16:40发布当日利率互换收盘曲线，每类曲线发布报买、报卖和均值三条曲线。



利率期权隐含波动率曲线

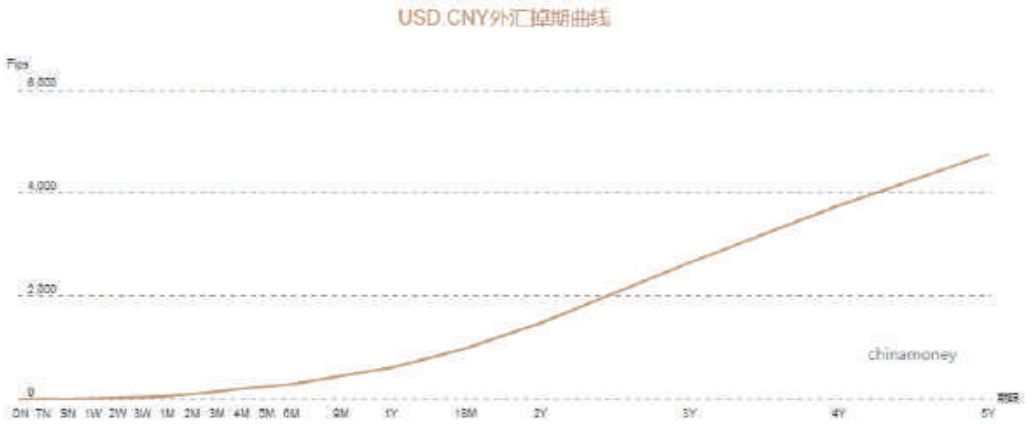
利率期权隐含波动率曲线以银行间市场交易平台日终报价为数据源，过滤异常报价后取算术平均作为关键期限点和行权价的波动率，可作为机构中后台对利率期权估值的参考基准。目前，利率期权隐含波动率曲线包括利率上/下限隐含波动率曲线和利率互换期权隐含波动率曲线。



外汇掉期曲线

以银行间外汇交易平台价格（成交价、询价报价、C-Swap订单报价）和货币经纪报价（可成交报价、意向报价）为数据样本，并过滤了异常交易价格，数据质量较高，可作为机构中后台外汇掉期等产品定价参考基准。

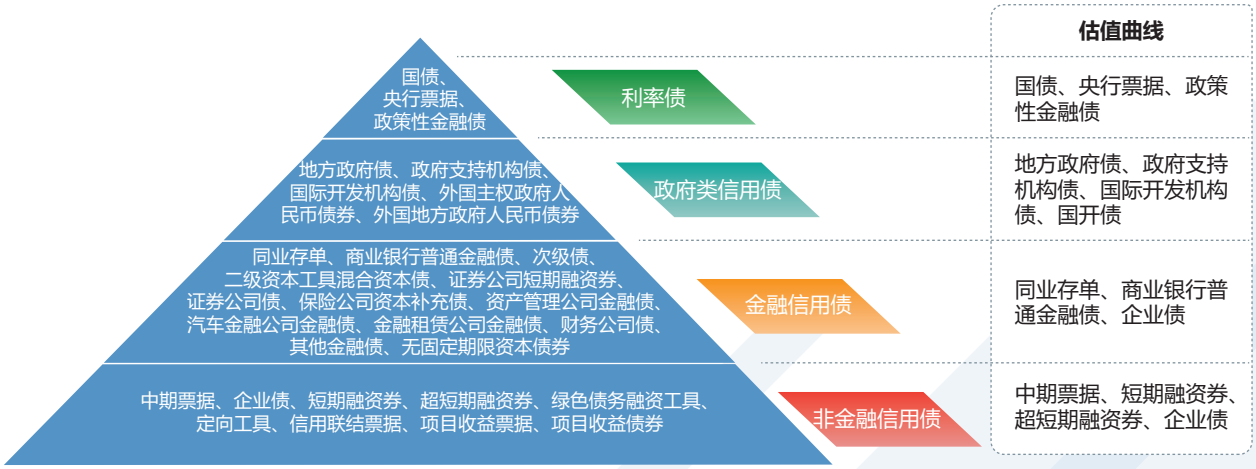
外汇掉期曲线覆盖USD.CNY、EUR.CNY、JPY.CNY、HKD.CNY、GBP.CNY等5个货币对，每个交易日开市期间（09:30至23:30）五分钟发布一次。



产品估值

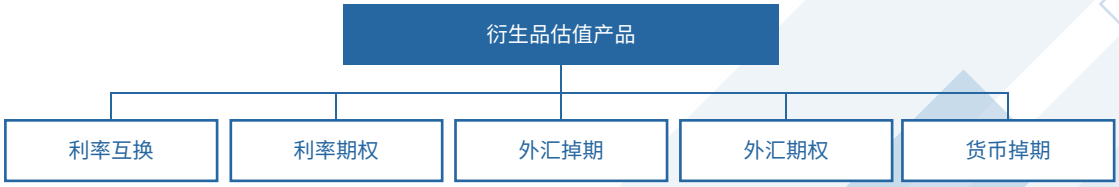
债券估值

为银行间市场上市流通债券提供的以债券收盘收益率曲线为基础的计算而得债券收盘估值，现已基本覆盖银行间市场存量债券类型，日常发布约3.6万只债券收盘估值，充分发挥同业存单一二级市场联动、现券做市商制度、X系列交易机制、债券拍卖处置等优势，在同业存单、高收益债、违约债等券种形成了具有交易中心特色的债券估值产品。



衍生品估值

为银行间市场利率互换、利率期权、外汇掉期、外汇期权、货币掉期等衍生品提供存量合约估值，现已形成由基础标的指标、曲线、估值、风险指标等所构成的一站式定价服务。其中，利率互换日常发布约25万笔估值，外汇掉期日常发布约14万笔估值。



指数类指标

交易中心充分利用银行间市场交易平台的数据优势，编制人民币汇率指数和债券指数。

人民币汇率指数

CFETS人民币汇率指数

参考CFETS货币篮子，具体包括CFETS挂牌的各人民币对外汇交易币种，样本货币权重采用考虑转口贸易因素的贸易权重法计算而得。篮子货币取价是当日人民币外汇汇率中间价和交易参考价。

BIS货币篮子人民币汇率指数

主要参考BIS货币篮子，样本货币权重采用BIS货币篮子权重。

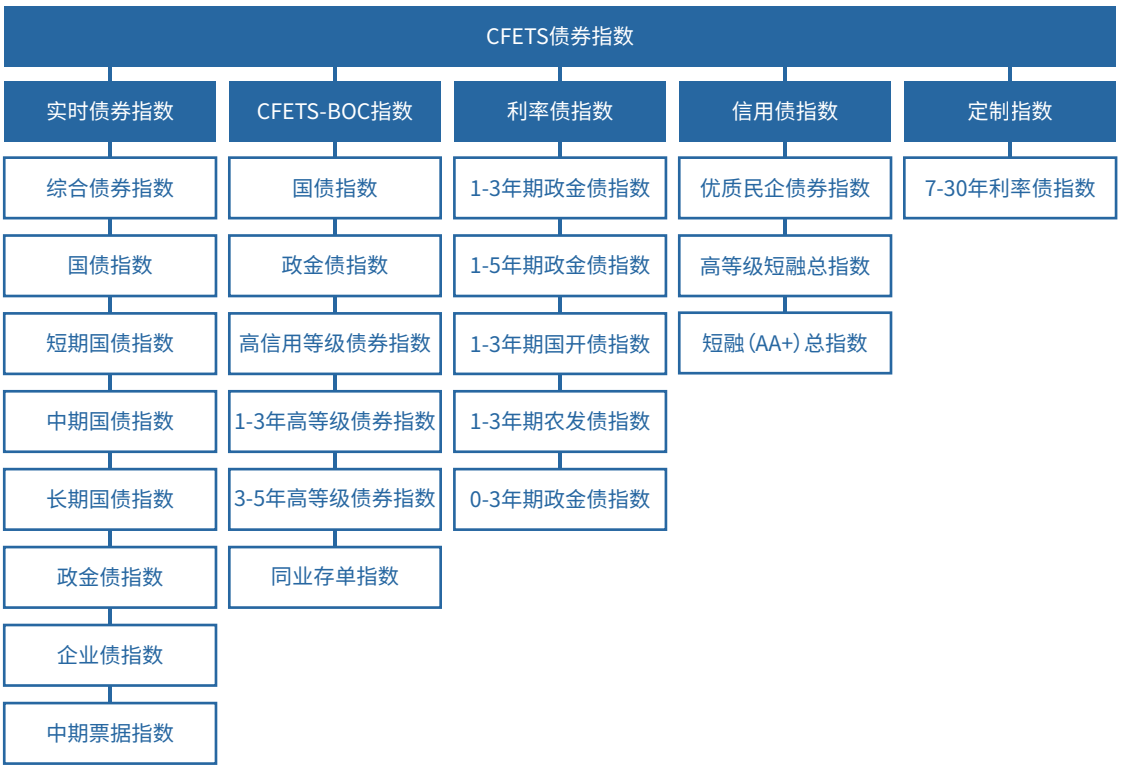
SDR货币篮子人民币汇率指数

主要参考SDR货币篮子，样本货币权重由各样本货币在SDR货币篮子的相对权重计算而得。

指数名称	当日指数	涨跌
CFETS人民币汇率指数	93.19	0.60 ▼
BIS货币篮子人民币汇率指数	96.95	0.61 ▼
SDR货币篮子人民币汇率指数	91.50	0.39 ▼

债券指数

交易中心陆续推出的债券指数包括实时债券指数、CFETS-BOC交易型债券指数、利率债指数、信用债指数、定制指数等多个指数系列。

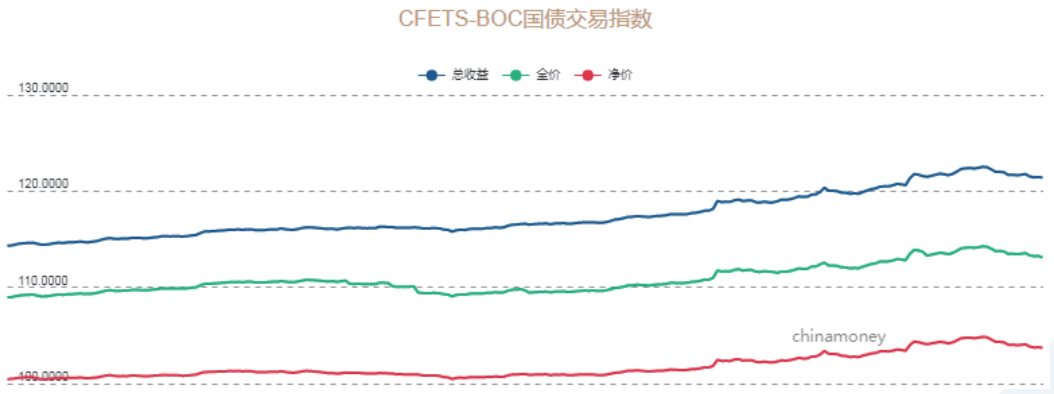


实时债券指数

根据市场做市报价、点击报价、现券成交价及债券估值，按照债券上市流通量作为权重，计算并发布的债券指数系列。每个交易日9点开始计算开盘指数，每5分钟更新一次，直至17点收盘。

CFETS-BOC交易型债券指数

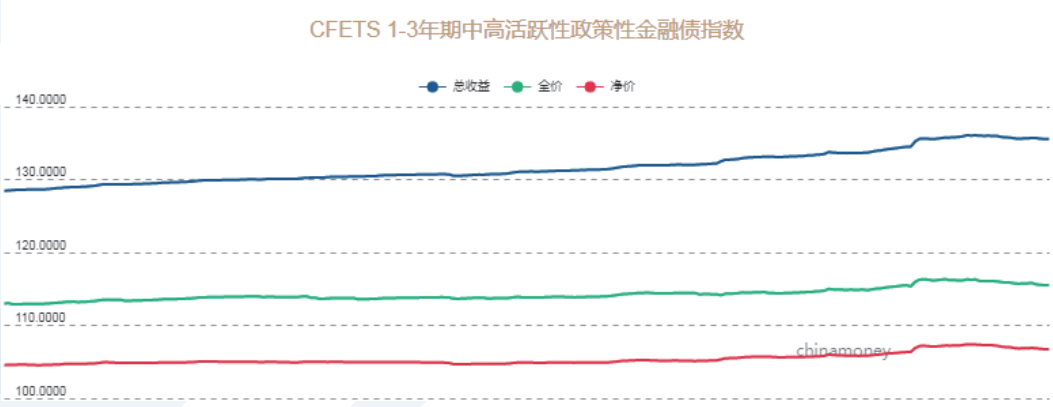
交易中心与中国银行于2018年共同编制了CFETS-BOC交易型债券指数。作为银行间市场首只交易型债券指数，该指数基于银行间市场各类债券的交易特点，综合考虑债券成交量等交易性因素，选取数量适中的活跃券作为指数样本券，既为境内外投资者提供了更好的业绩比较基准，也更便于复制和构建相关指数产品。该指数每个交易日收盘后更新一次指数价格。



总收益	全价	净价	指数平均修正久期	指数平均凸性	指数平均基点价值
121.4076	113.0951	103.7222	3.8741	25.5983	0.0405
指数总市值(亿元)	平均到期收益率(%)	总收益指数涨跌幅(%)	全价指数涨跌幅(%)	净价指数涨跌幅(%)	
28343.0181	1.9965	-0.0436	-0.1542	-0.0516	

利率债指数

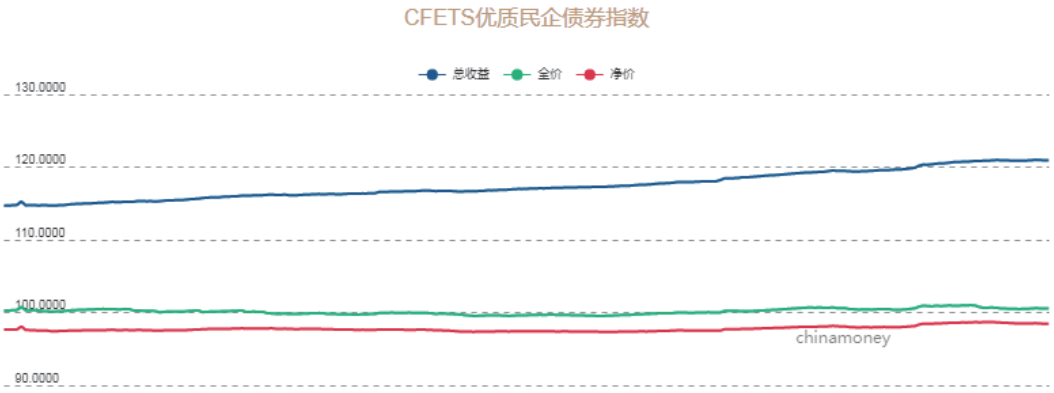
利率债指数主要跟踪国债和政策性金融债等利率债的价格变化和市场表现。在利率债指数中，交易中心尝试通过更加丰富的流动性指标筛选市场上相对活跃且数量适中的债券作为样本券，并根据市场需求，在稳定久期以及样本券周转率方面进行了技术改进。该指数每个交易日收盘后更新一次指数价格。



总收益	全价	净价	指数平均修正久期	指数平均凸性	指数平均基点价值
135.5579	115.5133	106.7223	1.8420	5.6759	0.0192
指数总市值(亿元)	平均到期收益率(%)	总收益指数涨跌幅(%)	全价指数涨跌幅(%)	净价指数涨跌幅(%)	
28167.7068	1.7915	-0.0049	-0.0049	-0.0140	

信用债指数

为响应支持民营经济发展的国家政策，交易中心发布了优质民企债券指数，通过引入第三方公司信用评分体系筛选资质较好的民营企业及其所发行的债券作为样本编制指数，充分反映民营企业债务工具的市场价格水平和收益水平。此外，交易中心还推出了高信用等级短期融资券总指数和短期融资券（AA+）总指数。这些指数每日收盘后更新一次指数价格。



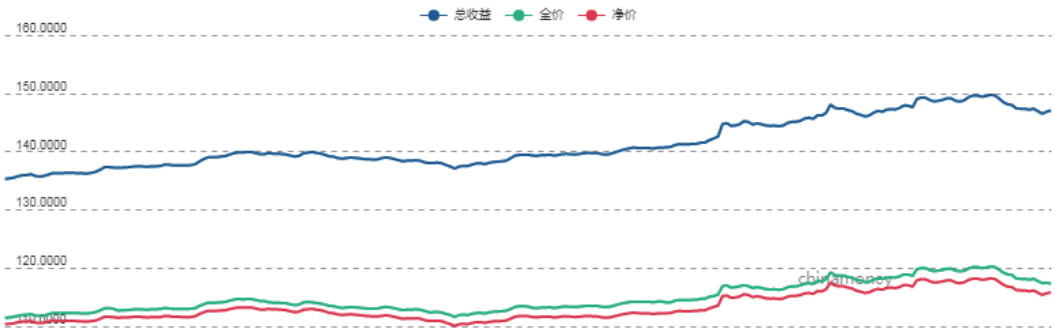
总收益	全价	净价	指数平均修正久期	指数平均凸性	指数平均基点价值
120.9489	100.5547	98.4505	1.4439	3.9773	0.0150
指数总市值(亿元)	平均到期收益率(%)	总收益指数涨跌幅(%)	全价指数涨跌幅(%)	净价指数涨跌幅(%)	
1371.8873	3.3637	0.0072	0.0073	-0.0052	

定制指数

交易中心根据市场参与者或研究机构需求进行指数合作，开发各类型指数。

CFETS-中信证券7-30年期利率债策略权重指数为交易中心为中信证券定制开发的长期限利率债指数。

CFETS-中信证券7-30年期利率债策略权重指数



总收益	全价	净价	指数平均修正久期	指数平均凸性	指数平均基点价值
147.0549	117.3236	115.8259	8.9583	123.1038	0.0960
指数总市值(亿元)	平均到期收益率(%)	总收益指数涨跌幅(%)	全价指数涨跌幅(%)	净价指数涨跌幅(%)	
50720.4188	3.1010	0.1553	-0.1259	0.1484	

数据获取渠道

- CMDS数据接口
- 交易终端
- 中国货币网
- 授权信息商终端/接口

数据挖掘

交易中心依托完整的交易数据库，为用户提供货币市场、债券市场、外汇市场、外币拆借市场等多维数据挖掘产品服务。该类产品量价清晰、统计维度合理、数据真实准确，可帮助用户了解市场每日资金供需情况，预判市场未来走势。

基础产品

货币市场盘中分机构统计产品

基于银行间市场完整的交易数据对不同机构类型的量价进行深度剖析并多维度反映市场日间变化。从期限品种、质押券等多维度掌握盘中价格变动与资金流向，监测市场变化，对市场流动性进行预判。

机构类型	期限品种	最新正回购成交利率(%)	较昨日涨跌(BP)	最新逆回购成交利率(%)	较昨日涨跌(BP)	加权平均利率(%)	较昨日涨跌(BP)	10:30 DR/R(%)	11:00 DR/R(%)	午盘后至15:30 DR/R(%)
股份制商业银行	R001	1.92	-8.7	1.92	-12.26	2.0211	-0.34	DR 1.9025	DR 1.9095	DR 1.9085
	R007	2.4	-10.96	2.55	-8.6	2.4358	-17.74	DR 2.4497	DR 2.4644	DR 2.3174
	R014	2.8	40	2.56	-12.17	2.6896	7.92	—	—	—
	R021	2.3	-9.62	—	—	2.5818	11.32	DR 2.5963	DR 2.5963	DR 2.4584
	R1M	2.6	-14.43	2.9	290	2.7123	-3.20	—	—	DR 2.6
	R2M	—	—	—	—	—	—	—	—	—
……	……									

货币市场盘后分机构统计产品

通过区分机构类型、期限品种、债券类型，挖掘货币市场微观结构，统计分析正/逆回购加权利率，剔除偏离平均水平较大的利率，公允定位各类型机构价格水平融入融出金额和余额，了解市场资金供需变化，并可从质押券角度洞察市场成交的量价情况。

机构类型	期限品种	正回购加权利率(%)	正回购加权利率-剔除超50BP(%)	正回购金额(百万)	逆回购加权利率(%)	逆回购加权利率-剔除超50BP(%)	逆回购金额(百万)	净融入金额(考虑今日到期量)(百万)	正回购余额(百万)	逆回购余额(百万)
基金公司及产品	R001	2.0550	2.0550	7455.20	1.6500	1.6500	3990.00	-555840.15	7455.20	3990.00
	R007	2.4342	2.4291	603380.82	2.5853	2.5941	134477.42	466435.71	853434.02	541329.56
	R014	3.0667	2.8526	4280.74	2.8061	2.7826	29221.67	-14386.69	23383.74	150756.07
	R021	3.1904	3.0457	375.52	2.8686	2.8659	30884.45	18135.27	37952.32	263248.51
	R1M	3.8894	4.3000	1883.63	2.9944	2.8938	3104.10	22592.40	21034.00	181010.22
	R2M	5.6281	5.5814	295.61	3.9516	3.8808	483.82	1668.19	18485.73	75841.73
	R3M	6.8160	7.0000	163.06	7.0000	7.0000	53.06	15.27	9135.69	54629.22
……	……									

现券市场盘后分机构统计产品

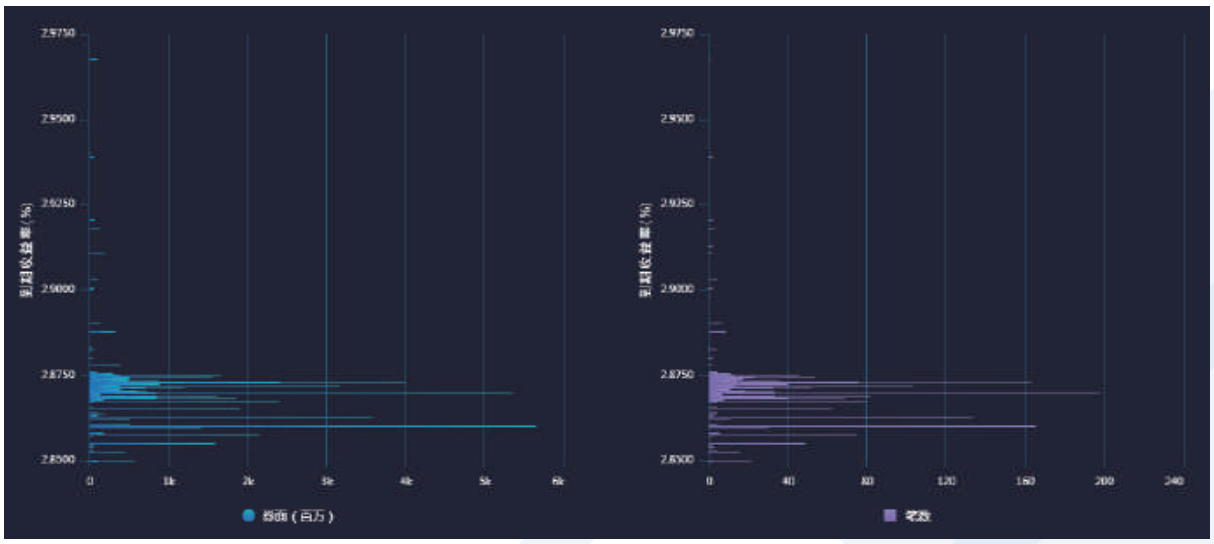
通过区分机构类型、债券类型、待偿期等维度对现券买入、卖出、净买卖情况进行挖掘，剔除干扰数据，准确分析机构在现券市场的交易行为。

机构净买入债券成交金额情况（单位：亿元）

机构类型	期限	国债-新债	国债-老债	政策性金融债-新债	政策性金融债-老债	…	企业债	同业存单	其他	合计
股份制商业银行	1年及1年以下	0.80	0.00	-1.80	0.30	…	—	-44.39	-0.41	-52.22
	1-3年	-1.00	-0.71	0.00	-2.75	…	-0.42	—	-0.65	-3.02
	3-5年	-2.49	-1.02	-1.19	6.00	…	-1.20	—	0.20	-2.08
	5-7年	-0.81	—	-1.78	-11.16	…	—	—	—	-20.27
	7-10年	-3.88	3.85	14.15	1.71	…	—	—	—	15.11
	10-15年	—	—	—	—	…	—	—	—	—
	15-20年	—	—	—	—	…	—	—	-2.54	-2.54
	20-30年	1.20	0.72	—	—	…	—	—	—	1.93

现券市场盘中统计产品

实时统计债券交易价格的分布情况，掌握债券交易量与笔数的收益率集中分布情况，为投资者跟踪债券市场交易行为，判断市场走势，制定交易策略提供数据参考。



同业存单市场盘后统计产品

通过对同业存单一级发行、二级交易情况的剖析，从发行人机构类型、投资人机构类型、待偿期多角度进行统计分析，了解一级市场发行趋势与各类型机构的配置需求。

存单分类 投资人	主要股份制银行同业存单（亿元）						……
	1M	3M	6M	9M	1Y	合计	……
大型商业银行/政策性银行	—	—	—	—	3100	3100	……
股份制商业银行	1500	—	—	—	1620	3120	……
城市商业银行	2580.00	—	—	—	13020.00	15600.00	……
农村金融机构	1200	320	180	50	2810	4560	……
证券公司	—	—	—	—	—	—	……
保险公司	—	—	—	—	—	—	……
基金公司及产品	—	—	—	—	—	—	……
其他产品类	60	—	—	500	2500	3060	……
其他	1000	500	—	—	1000	2500	……

深度产品

数据挖掘深度产品是交易中心对银行间交易数据库进行深度挖掘的首次尝试，通过大数据技术将银行间市场涉及参与机构和本外币交易品种的海量数据进行联动分析，为用户提供了全面、准确的市场画像、机构个体表现、产品生命周期状态变动等数据服务。

人民币市场

质押式/买断式回购分机构交易报告

通过对本机构的交易在期限品种、交易方向等维度上与不同机构类型的交易进行比较分析，为机构回溯历史交易表现提供精准的衡量工具。同时，提供了针对不同类型质押物/抵押品的接受比例和折算率走势分析，为机构质押物/抵押品的交易定价起到参考作用。

正回购成交价对比

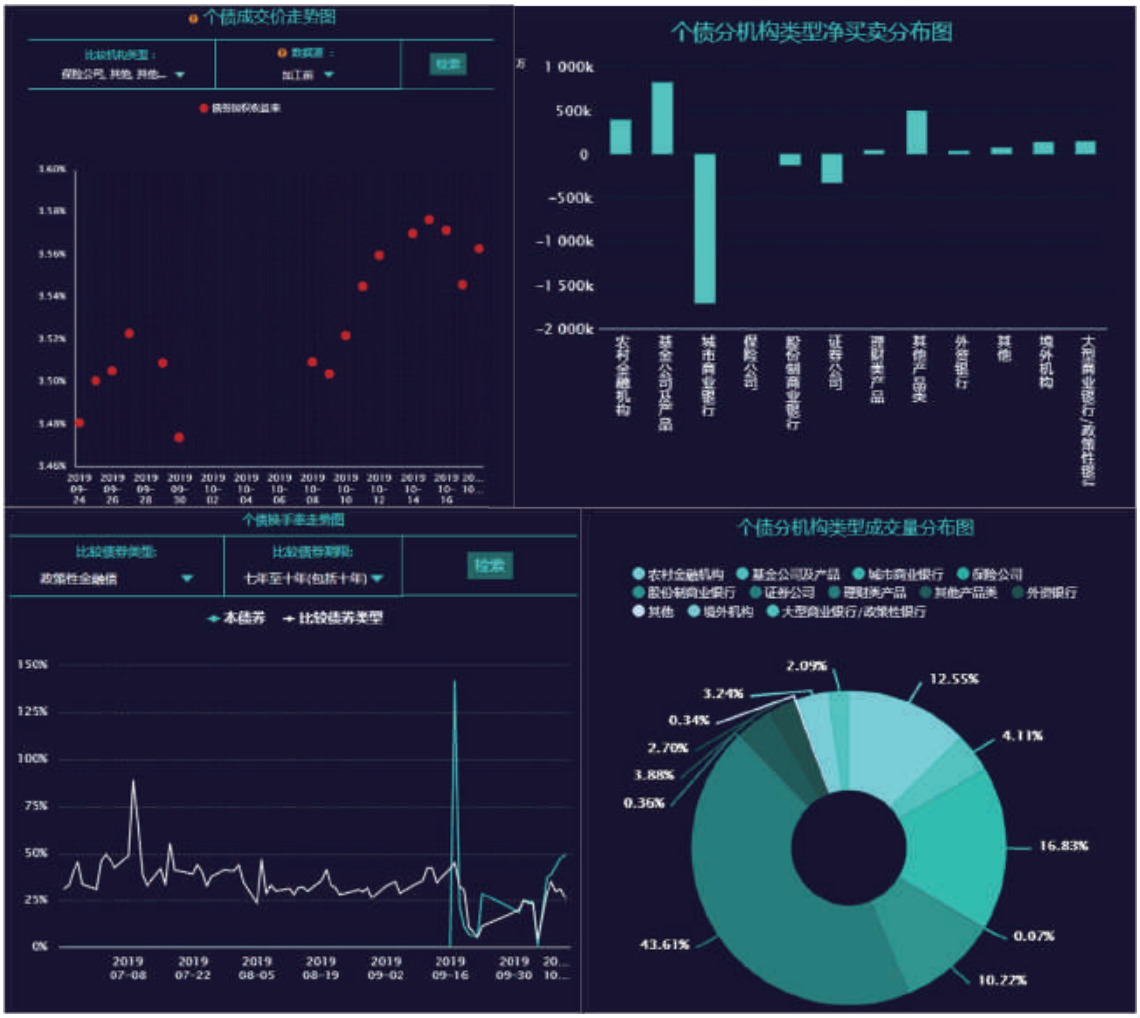
产品类型	交易频率(天)	与比较机构类型价格比较(BP)	与银银间加权成交价比较(BP)	与全市场加权成交价比较(BP)
R001 (1天)	12/17	2.43 (1天)	15.58 (1天)	10.57 (1天)
R007 (4.03天)	11/17	-5.28 (5.09天)	3.49 (6.48天)	-5.90 (5.66天)
R014 (12.64天)	5/17	6.11 (13.27天)	26.03 (12.62天)	7.88 (12.71天)
全期限 (1.94天)	14/17	-1.55 (3.29天)	20.59 (1.98天)	9.36 (3.01天)

逆回购成交价对比

产品类型	交易频率(天)	与比较机构类型价格比较(BP)	与银银间加权成交价比较(BP)	与全市场加权成交价比较(BP)
R001 (1天)	11/17	-11.12 (1天)	18.10 (1天)	13.13 (1天)
R007 (4.19天)	7/17	5.91 (5.57天)	33.17 (6.48天)	22.16 (5.66天)
R014 (10.81天)	2/17	-10.72 (13.09天)	21.77 (12.62天)	2.60 (12.71天)
全期限 (3.23天)	15/17	-16.43 (5.33天)	42.44 (1.98天)	28.40 (3.01天)

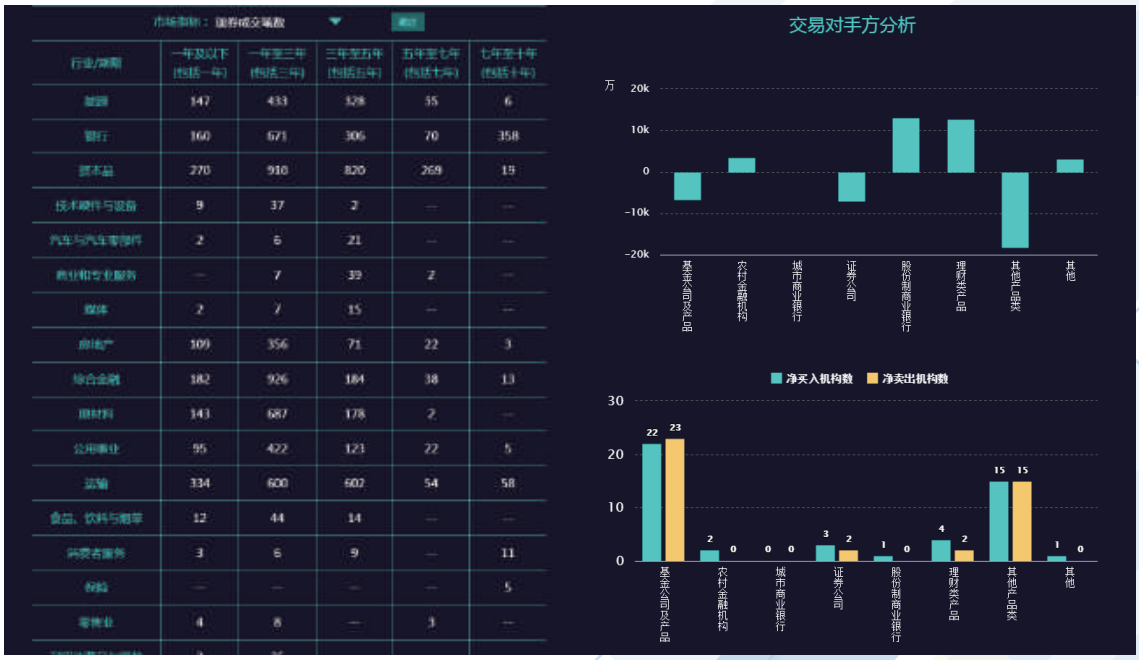
现券市场个债交易报告

从活跃券基本信息及交易信息、活跃券交易方分析、活跃券成交价分析、债券活跃度分析等维度对现券市场活跃债券进行全面分析。



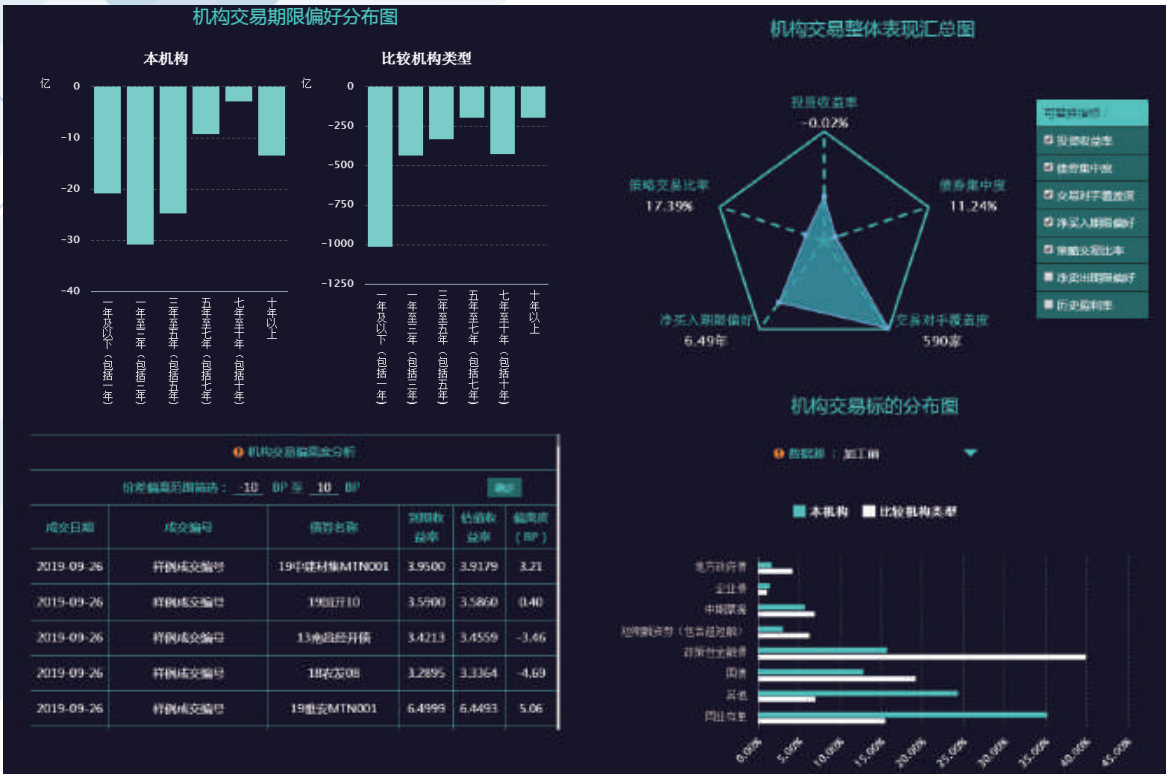
现券市场分行业信用债交易报告

从信用债行业概览、到期收益率走势分析、信用债交易对手分析、信用债活跃度分析、信用债质押程度分析等维度分析信用债市场整体情况。



现券市场分机构交易报告

从机构交易整体表现、机构收益性分析、机构交易债券偏好、机构交易对手方偏好、机构交易期限偏好等维度分析本方机构交易表现，并与其他类型机构进行比较。

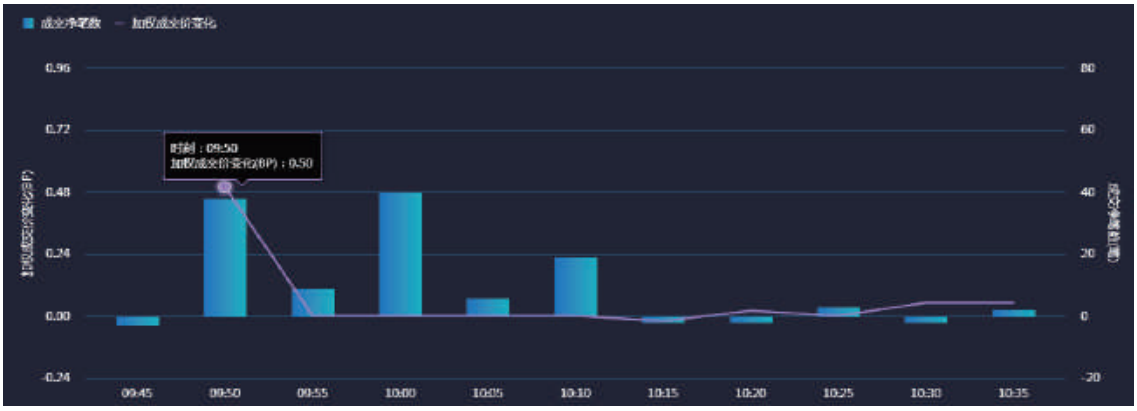


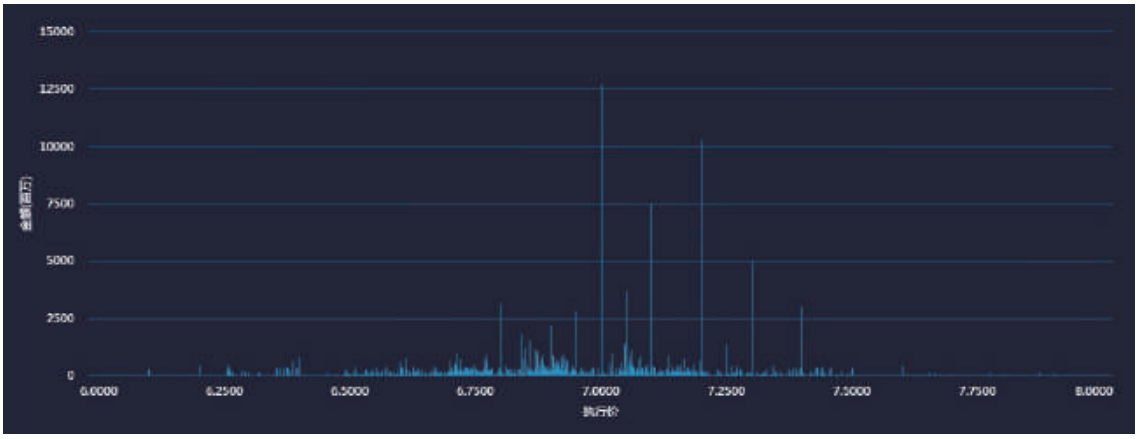
外汇市场

外汇掉期市场

实时分析外汇掉期市场不同机构类型、不同价格档位的成交情况，展示市场深度指标，分析本机构各交易对手的量价情况。

时间段	成交净量(百万)	成交净笔数(笔)	加权成交价(BP)	加权成交价变化(BP)	最优报价均值(BP)	最优报价均值变化(BP)
09:40-09:45	-100.00	-3	-0.50	---	-0.20	---
09:45-09:50	1396.00	38	0.00	0.50	-0.10	0.10
09:50-09:55	212.00	9	0.00	0.00	-0.03	0.07
09:55-10:00	1280.00	40	0.00	0.00	-0.03	0.00
10:00-10:05	151.00	6	0.00	0.00	-0.03	0.00
10:05-10:10	1049.00	19	0.00	0.00	-0.02	0.01
10:10-10:15	-200.00	-2	-0.02	-0.02	-0.02	0.00
10:15-10:20	-50.00	-2	0.00	0.02	0.00	0.02
10:20-10:25	29.00	3	0.00	0.00	0.10	0.10
10:25-10:30	-10.00	-2	0.05	0.05	0.08	-0.02
10:30-10:35	100.00	2	0.10	0.05	0.10	0.02



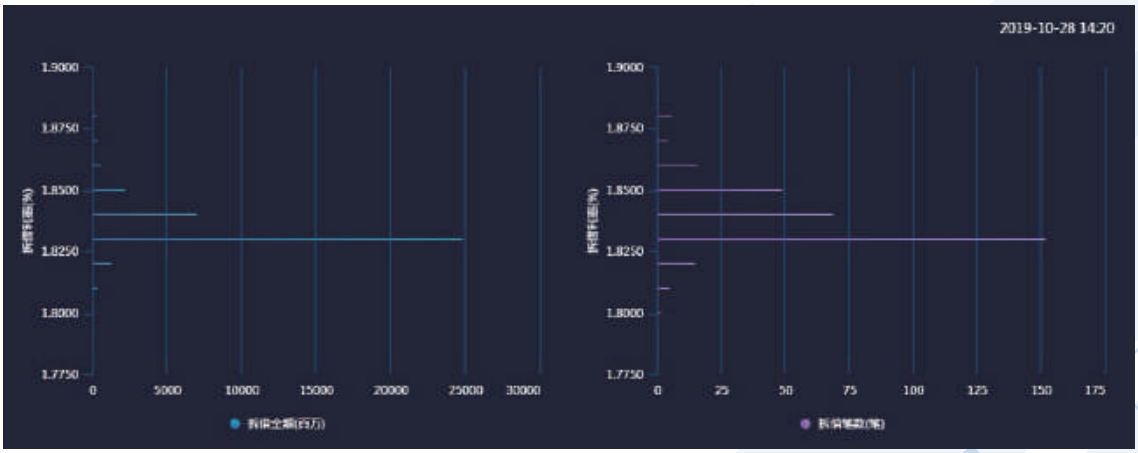


外汇期权市场

展示外汇期权市场存量合约的价格、到期日分布情况。

外币拆借市场

分机构类型统计外币拆借市场盘中、盘后成交价格与成交量情况，实时分析市场不同价格档位成交情况，本机构各交易对手的量价情况等。



币种	期限	机构类型	拆入金额(百万拆借币种)	拆入加权利率(%)	拆出金额(百万拆借币种)	拆出加权利率(%)
USD	ON	大型商业银行	4973.00	0.19	15132.00	0.16
		城市商业银行	4384.00	0.21	3040.00	0.21
		境外银行	4325.00	0.07	---	---
		股份制商业银行	9450.00	0.20	5092.00	0.20
		外资银行	1960.00	0.21	1966.00	0.19
		农村金融机构	681.00	0.21	543.00	0.21
	1W	大型商业银行	2865.00	0.32	7891.00	0.37
		城市商业银行	676.00	0.48	466.00	0.49
		境外银行	3980.00	0.38	15.00	0.25
		股份制商业银行	1740.00	0.35	970.00	0.38
		外资银行	344.00	0.37	513.00	0.36
		农村金融机构	607.00	0.50	357.00	0.36
	2W	城市商业银行	42.00	0.65	40.00	0.65
		农村金融机构	2.00	0.65	4.00	0.70
	1M	境外银行	35.00	0.85	---	---
		股份制商业银行	---	---	35.00	0.85
		农村金融机构	5.00	1.00	5.00	1.00
	1M-3M	城市商业银行	8.00	1.30	8.00	1.30
	3M	农村金融机构	2.00	1.68	2.00	1.68
EUR	ON	城市商业银行	---	---	12.00	0.10
		外资银行	35.00	-0.30	35.00	-0.30
		其他	42.00	0.14	30.00	0.15
		大型商业银行	---	---	100.00	0.05

数据获取渠道

- iData
- 交易终端

参考数据——债券基础信息

为方便机构获取到准确及时的债券基本要素信息，交易中心为机构提供债券基础信息服务，帮助用户及时更新参考信息、掌握债券准确动态。

债券基本信息

包含各类债券的基本信息、发行、增发信息、息票、含权、担保及承继等信息，供用户全面了解债券的整体情况（暂列部分字段）。

债券简称	债券全称	债券代码	ISIN码
债券英文全称	债券英文简称	债券类型	债券发行日
到期兑付日	债券摘牌日	债券期限	年化债券期限
交易市场	流通范围	适用市场	起息日
计划发行量总额(亿)	实际发行量（亿）	流通量	币种
发行价格(元)	发行方式	上市交易日	托管机构
含权类型	行权日期	担保机构	承继机构

发行人基本信息

包括发行人的所属行业、机构性质及注册地，便于用户对发行人的地区与行业有所了解，便于分析与比较行业与地区的债券发行状况。

机构中文全称	机构中文简称	机构英文全称	机构英文简称
社会统一信用代码	注册资本	所属行业	是否上市
发行人或最大股东性质	机构性质	注册地	成立日期

付息信息

将债券生命周期内的付息日程进行全程展示 。

交易提示信息

提供30个自然日的事件类型:上市（上市*）、付息、摘牌、到期、行权信息 。

日期	事件类型	债券全称	债券简称	债券代码	行权种类

主体或债券评级信息

对机构或债券的评级情况进行全面跟踪的展示。

评级生效日	评级截止日	主体/债券评级	评级公司
评级展望	评级变动方向	评级类别	评级变动原因

数据获取渠道

- 中国货币网
- 授权信息商终端

数据获取渠道说明

交易中心通过数据接口、交易终端、iData、中国货币网、授权信息商等多种渠道提供数据信息服务。

CMDS数据接口

CMDS(CFETS Market Data Service)接口可提供高质量、标准、可靠的银行间本外币市场的报价、成交行情和各类市场基准指标，为市场分析、数据模型建立、风险控制等提供准确有效的数据支持。

CMDS Pro高速数据接口

CMDS Pro接口可提供人民币对美元及外币对即期撮合交易行情数据高速接口服务，能够高频率、低延迟地实时更新市场报价和成交行情数据，每秒可按需发送至多近1万笔更新行情，延迟在10毫秒以内。

交易终端

交易中心向银行间本外币市场提供交易服务的终端。该交易终端同时提供市场数据、基准数据、数据挖掘产品等数据信息服务。

iData

交易中心基于互联网搭建的数据信息服务平台。用户可通过中国货币网（首页数据栏目及专区入口进入）等网站跳转至此平台专区。用户在该平台登录后，可一站式访问数据挖掘基础产品及深度产品、基准产品等。

中国货币网

由交易中心主办的中国货币网（www.chinamoney.com.cn）是中国人民银行指定的银行间市场信息发布平台，提供市场基本行情、基准数据及债券基础信息的查询与展示。

授权信息商

交易中心向授权信息商提供市场数据、基准数据及债券基础信息数据，信息商通过其信息终端向用户展示数据，或以接口等方式向用户提供相应数据服务。

中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心（以下简称交易中心）是中国人民银行直属事业单位，是我国金融市场重要的基础设施。交易中心利用先进的电子信息技术，为银行间外汇市场、货币市场、债券市场等现货及衍生产品市场提供交易、发行、交易后处理、数据信息等服务。

中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心

地址:上海市浦东新区张东路1387号40幢
邮编:201203
电话:4009787878-4
86-21-38585533/23165101
传真:86-21-68797900
邮箱:chinamoney@chinamoney.com.cn
中国货币网:www.chinamoney.com.cn

如需获取CFETS数据信息服务
更多信息,请扫描二维码

本手册内容仅供机构内部参考，相关知识产权及权利归交易中心所有。未经交易中心同意，不得擅自对外传播扩散或非法使用。交易中心不保证手册中图片、数据等内容的准确性或完整性，亦不对机构因信赖本手册而产生的后果承担责任。