常规报告系列

收盘日评
银行间外汇衍生品市场

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2025-05-26】

今日美元/人民币中间价报 7.1833，较上一个交易日下调 86bp，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

TN 成交在 -5.7~-5.3 ； SN 成交在 -5.48~-5.31 之间。

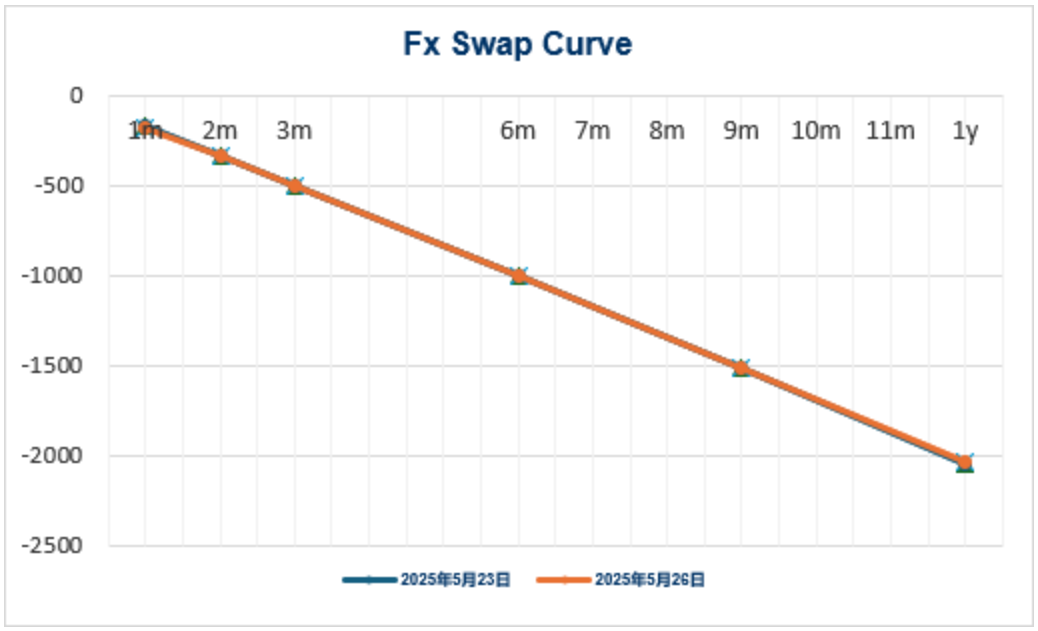
1w 成交在 -38，-37.95，-37.7，-37.51 的位置；2w 成交在 -75.6 的位置； 1S 反复成交在 -182，-181，-180.8 的位置；2s 成交在 -336，-335 的位置；3s 成交在 -505，-503，-502.5，-502 的位置 ；

中长期限， 6s 成交在 -1007，-1006，-1005，-1003，-1002 附近； 9s 成交在 -1525，-1520，-1518，-1517，-1515，-1512，-1510 附近；1Y 成交在 -2050，-2048，-2045，-2043，-2040，-2035 的位置 ；

Spread 方面， 6s*1y 成交在 -1033,-1030 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	**7**	-37	7.1806	0
2W	**14**	-76	7.1768	-40
1M	**33**	-180	7.1663	-10.63
2M	**61**	-334	7.1509	6
3M	**92**	-501	7.1342	0
6M	**184**	-1000	7.0843	5
9M	**275**	-1510	7.0333	8
1Y	**365**	-2030	6.9813	14
18M	**551**	-2900	6.8943	0
2Y	**730**	-3510	6.8333	10
3Y	**1098**	-4725	6.7118	20
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1833	
CLOSING SPOT RATE			7.1843	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	**3M**	**6M**	**9M**	**1Y**
1M	-154.37	-321.37	-820.37	-1330.37	-1850.37
2M		-167	-666	-1176	-1696
3M			-499	-1009	-1529
6M				-510	-1030
9M					-520



文 / Ray Yan

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。