

收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列

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

【2025-03-31】

今日美元/人民币中间价报 7.1782，较上一个交易日上调 30bp，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

ON 成交在 -1~Par；TN 成交在 -4.5~-3.6；SN 成交在 -4.5~-4.35 之间。

1w 成交在 -32.5,-32.4,-32.3 的位置；1S 反复成交在 -157~-156 之间；2s 成交在 -292 的位置；3s 成交在 -439,-438.5,-438,-437.5 的位置；4s 成交在 -608 的位置；

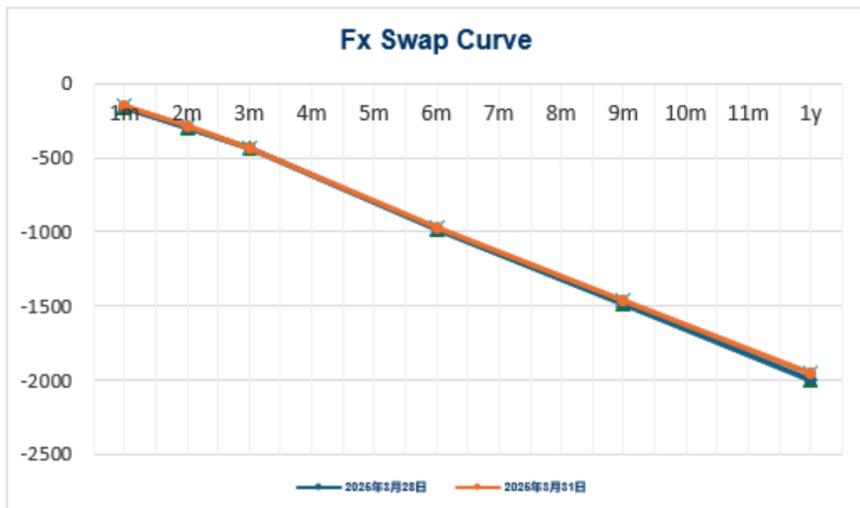
中长期，6s 成交在 -971, -968, -965 附近；9s 成交在 -1465, -1455 附近；1Y 成交在 -1961,-1960,-1958,-1955,-1950,-1948 的位置；

超长期限，3y 成交在 -4650 的位置；

Spread 方面，3s*6s 成交在 -531,-530,-528 的位置；4s*5s 成交在 -157 的位置；5s*6s 成交在 -206,205 的位置；6s*1y 成交在 -986,-984 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	10	-32	7.2484	-0.63
2W	14	-65	7.2452	-1
1M	31	-156	7.2360	3.5
2M	61	-292	7.2224	4
3M	94	-438	7.2079	-1.5
6M	185	-969	7.1547	16
9M	276	-1467	7.1049	21
1Y	367	-1955	7.0561	40
18M	549	-2800	6.9716	65
2Y	731	-3545	6.8971	0
3Y	1096	-4650	6.7866	190
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1782	
CLOSING SPOT RATE			7.2516	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-136	-281.5	-813	-1311	-1799
2M		-145.5	-677	-1175	-1663
3M			-531.5	-1029.5	-1517.5
6M				-498	-986
9M					-488



免责声明：本日报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、发表或引用日报内容。日报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报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。