



【2025-06-05】

今日美元/人民币中间价报 7.1865，较上一个交易日下调 21bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

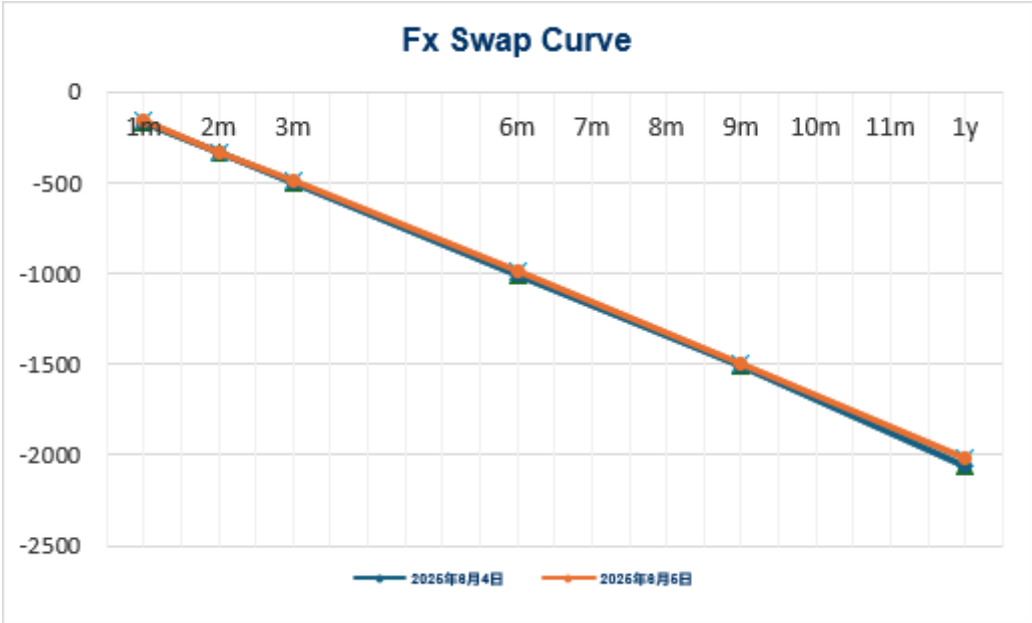
ON 从-5.05 买到-4.8；TN 从-14.8 给到-15.15，后买回-15.05；SN 成交在-5.13~-5.03 附近。1W 成交在-36；2W 成交在-72.85~-72.8 附近。1S 从-159 买到-158、157.7；2S 成交在-336；3S 成交在-495~-490 附近。

中长期限，6S 从-982 买到过-981.5、-980、-978，后给回-983、-984、-986、-987；9S 成交在-1486；1Y 从-2022 买到-2020、-2012、-2011，后给回-2014、-2021、-2022。

Spread 方面，3*6S 成交在-490，6*12S 成交在-1040、-1035、-1033、-1030、-1028，9*11S 成交在-362、-363。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-36	7.1802	0.1
2W	14	-73	7.1765	2
1M	30	-158	7.1680	7.42
2M	63	-336	7.1502	-6
3M	92	-492	7.1346	14.1
6M	183	-985	7.0853	23
9M	273	-1492	7.0346	20
1Y	365	-2022	6.9816	44
18M	548	-2835	6.9003	83
2Y	731	-3460	6.8378	70
3Y	1096	-4600	6.7238	140
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1865	
CLOSING SPOT RATE			7.1838	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-178.01	-334.11	-827.21	-1334.21	-1864.21
2M		-156.1	-649.2	-1156.2	-1686.2
3M			-493.1	-1000.1	-1530.1
6M				-507	-1037
9M					-530



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。