

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

【2025-04-03】

今日美元/人民币中间价报 7.1889，较上一个交易日上调 96bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 早盘在-20.5~-19.47 之间来回成交，午后给到-21.5；TN 从-4.75 买到-4.6 后一路给到-4.81，尾盘买到-4.68；SN 从-4.75 买到-4.7，后给回-4.77，尾盘买到-4.72。1W 从-34.5 买到-34.03；2W 成交在-102 附近。1S 早盘在-143~-140.5 之间来回成交，午后给到-145；2S 成交在-313.2~-302 附近，尾盘收在-307.5；3S 从-455 给到过-457、-458、-460、-466。

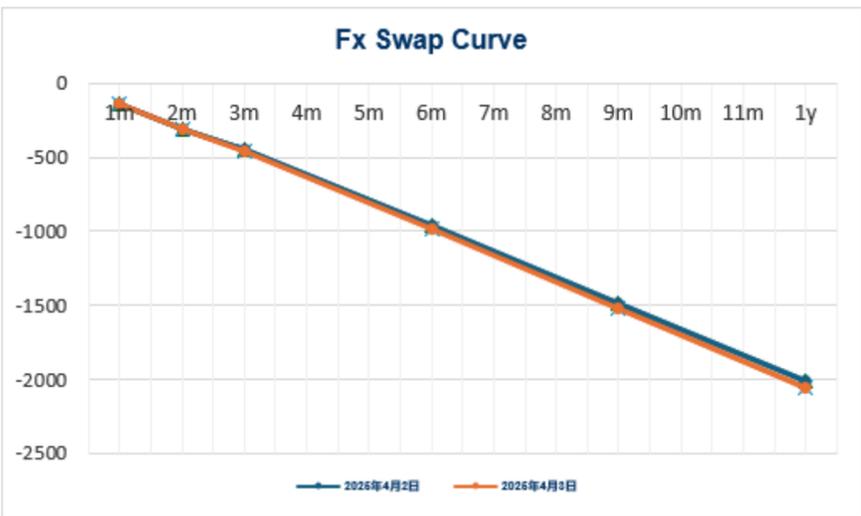
中长期，6S 从-990 买到-987、-986，后给回-988；9S 从-1504 给到-1515、-1520；1Y 从-2025 最低给到-2060，后买回-2055、-2053、-2051。

超长期限，18S 成交在-2900，2Y 成交在-3560。

Spread 方面，3*6S 成交在-525，6*12S 成交在-1070，9*12S 成交在-530。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-34	7.3009	-0.85
2W	14	-68	7.2975	-1
1M	30	-144	7.2899	-1
2M	62	-308	7.2735	-1
3M	91	-462	7.2581	-11
6M	184	-986	7.2057	-20
9M	275	-1523	7.1520	-37
1Y	365	-2053	7.0990	-45
18M	548	-2900	7.0143	-50
2Y	730	-3530	6.9513	-10
3Y	1098	-4850	6.8193	-75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1889	
CLOSING SPOT RATE			7.3043	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-164	-318	-842	-1379	-1909
2M		-154	-678	-1215	-1745
3M			-524	-1061	-1591
6M				-537	-1067
9M					-530



文 / Cathy He

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。