



【2022-06-02】

今日美元/人民币中间价报 6.7095，较上一个交易日上调 444bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

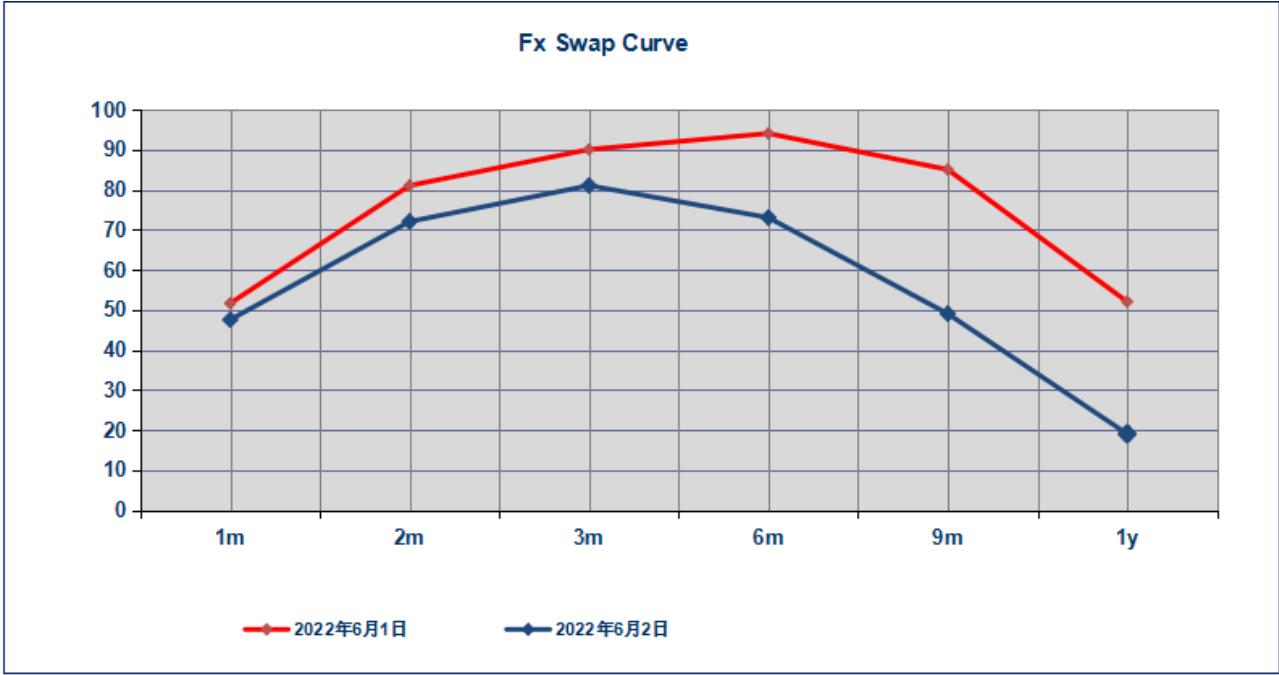
ON 成交在+6~+6.5 之间；TN 从+1.6 买到+1.63，后又给到+1.32；SN 成交在+1.48~+1.6 之间。1W 成交在+10.35~+11.25 之间；2W 成交在+21 附近。1S 成交在+48.5 附近；2S 从+75 给到+71.5；3S 成交在+81 附近。

中长期限，6S 从+75 给到+71，1Y 成交在+15~+25 之间。

Spread 方面，1W*1S 成交在+38；1*2S 成交在+24、+25；2*3S 成交在+9。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	10	6.6760	-1.05
2W	14	21	6.6771	-1
1M	30	48	6.6798	-4.1
2M	62	72	6.6822	-9
3M	92	81	6.6831	-9
6M	183	73	6.6823	-21
9M	273	49	6.6799	-36
1Y	365	19	6.6769	-33
18M	548	-30	6.6720	-30
2Y	731	-60	6.6690	-40
3Y	1098	-58	6.6692	-38
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7095	
CLOSING SPOT RATE			6.6750	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	24.5	33.5	25.5	1.5	-28.5
2M		9	1	-23	-53
3M			-8	-32	-62
6M				-24	-54
9M					-30



文 / Cathy He

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