



【2022-05-27】

今日美元/人民币中间价报 6.7387，较上一交易日上调 621bp，全天掉期市场交投较为活跃。

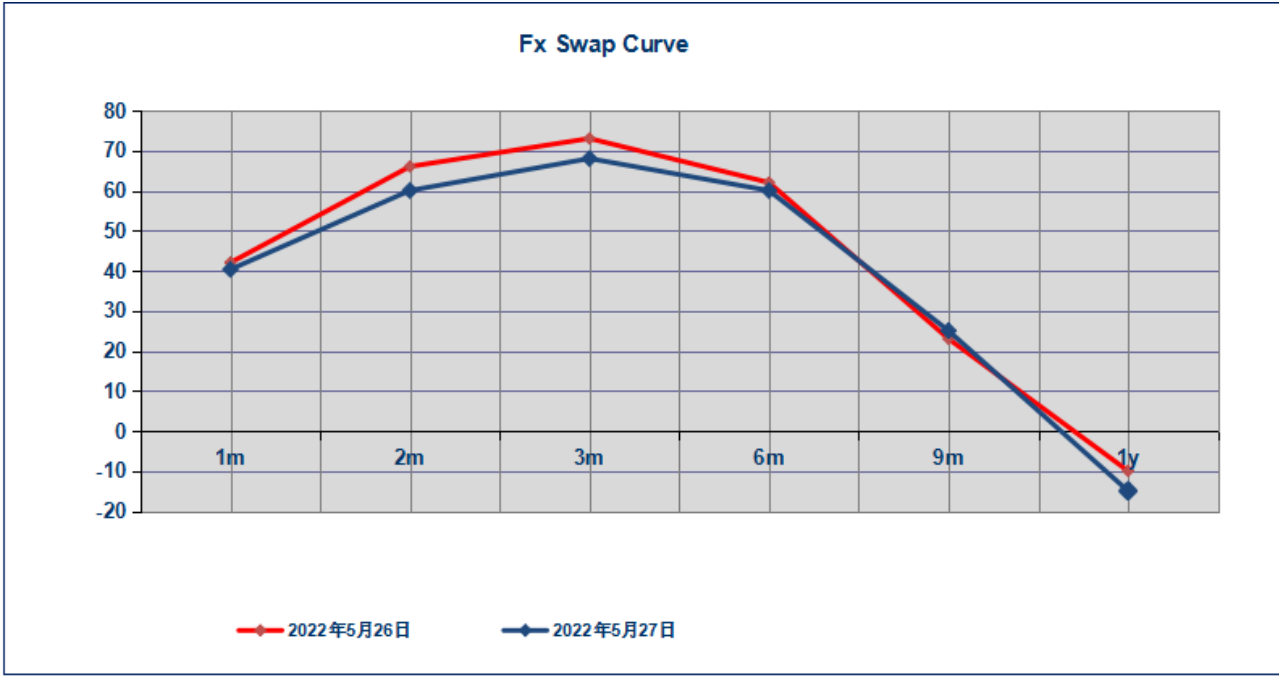
O/N 主要成交在+4.4~+4.7；S/N 主要成交在+4.4~+5.9；1w 成交在+12.5；1s 成交在+38，+40；3s 成交在+65~+70。

中长期限，9s 主要成交在+16；2y 成交在-120；

Spread，1s*3s 成交在+28。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	13	6.7094	-1.38
2W	14	23	6.7104	-2
1M	30	40	6.7121	-1.7
2M	59	60	6.7141	-6
3M	92	68	6.7149	-5
6M	183	60	6.7141	-2
9M	273	25	6.7106	2
1Y	365	-15	6.7066	-5
18M	548	-60	6.7021	0
2Y	731	-118	6.6964	3
3Y	1095	-120	6.6961	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7387	
CLOSING SPOT RATE			6.7081	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	19.7	27.7	19.7	-15.3	-55.3
2M		8	0	-35	-75
3M			-8	-43	-83
6M				-35	-75
9M					-40



文 / Edison Zeng

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