

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列

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

【2022-05-19】

今日美元/人民币中间价报 6.7524，较上一交易日上调 103bp，大部分期限收盘价较上一交易日略微有所下降，相差不大。

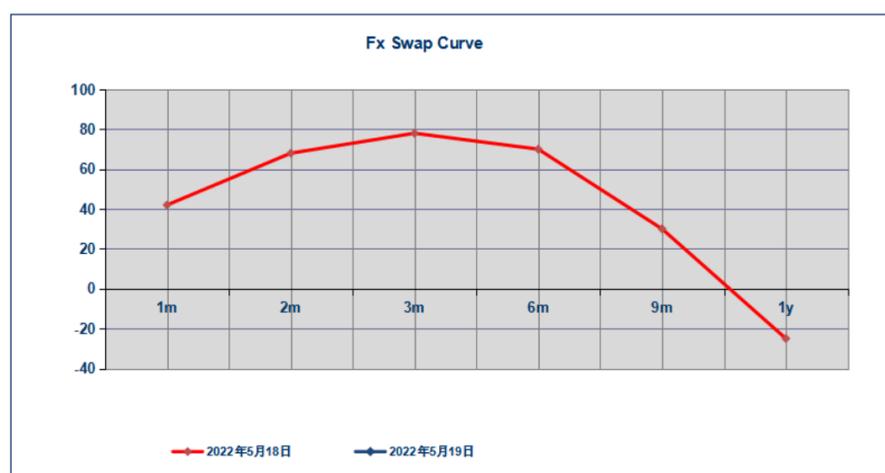
ON 主要成交在+1.2~+1.5 附近；TN 主要成交在+3.9~+4.1 之间；SN 主要成交在+1.25~+1.4 之间；1w 主要成交在+11.5, +10.5, +11 附近的位置；1s 成交在+43, +44, +46 附近。2s 成交在+70, +72 附近的位置；3s 成交在+75, +76, +78 等位置。6s 主要成交在+62, +63, +68, +70, +67 附近的位置。9s 成交在+23, +22, +20, +15, +27 附近。1y 成交在-20, -24, +30, -35 附近的位置。

超长方面，18s 成交在-120, -115 的位置。

Spread 方面，6s*9s 成交在-40 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	11	6.7689	1.69
2W	14	22	6.7700	2
1M	31	45	6.7723	3
2M	63	71	6.7749	3
3M	92	77	6.7755	-1.2
6M	184	69	6.7747	-2
9M	276	27	6.7705	-3
1Y	365	-32	6.7646	-7
18M	550	-130	6.7548	-60
2Y	731	-190	6.7488	-25
3Y	1096	-200	6.7478	-10
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7524	
CLOSING SPOT RATE			6.7678	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	26	31.8	23.5	-18	-77
2M		5.8	-2.5	-44	-103
3M			-8.3	-49.8	-108.8
6M				-41.5	-100.5
9M					-59



文 / Yiff Wang

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:

以上所提及的所有信息 (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