



【2022-05-26】

今日美元/人民币中间价报 6.6766，较上一交易日上调 216bp，全天掉期市场交投较为活跃。

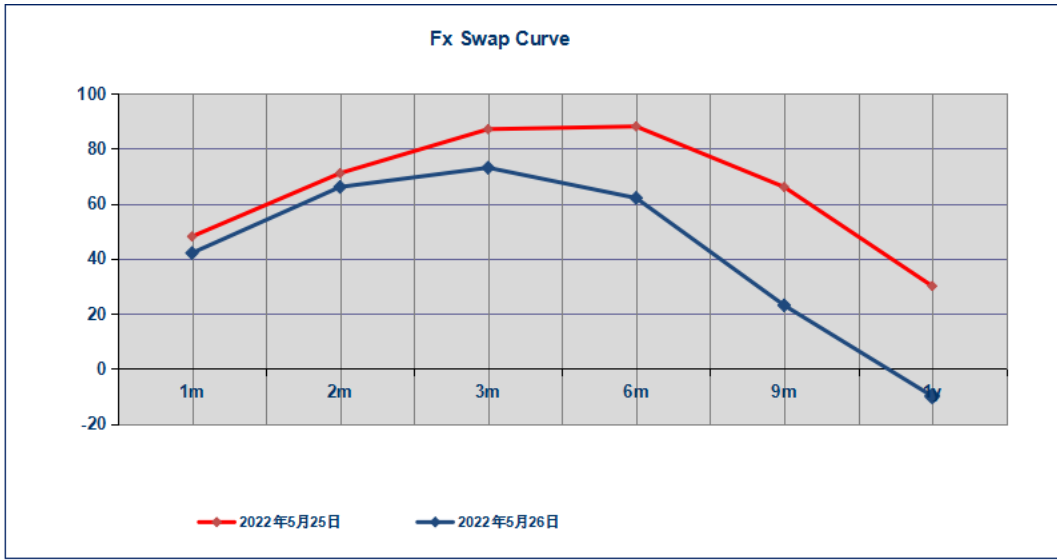
O/N 主要成交在+1.2~1.28；T/N 主要成交在+4.6~+5.2；S/N 主要成交在+6.8~+7.2；1w 成交在+13.7~+14；1s 成交在+41，+43；3s 成交在+77。

中长期限，6s 成交在+68~+77；9s 主要成交在+21，+30；1y 主要成交在-18；2y 成交在-100；

Spread，1w*2w 成交在+9；2w*1s 成交在+18；3s*6s 成交在 Par。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	14	6.7395	-5.92
2W	14	25	6.7406	-2
1M	30	42	6.7423	-6
2M	59	66	6.7447	-5
3M	92	73	6.7454	-14
6M	183	62	6.7443	-26
9M	273	23	6.7404	-43
1Y	365	-10	6.7371	-40
18M	548	-60	6.7321	-40
2Y	731	-120	6.7261	-60
3Y	1095	-120	6.7261	-60
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.6766	
CLOSING SPOT RATE			6.7381	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	24	31	20	-19	-52
2M		7	-4	-43	-76
3M			-11	-50	-83
6M				-39	-72
9M					-33



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