



【2022-05-30】

今日美元/人民币中间价报 6.7048，较上一个交易日下调 339bp，各期限收盘价较上一交易日大幅上行。

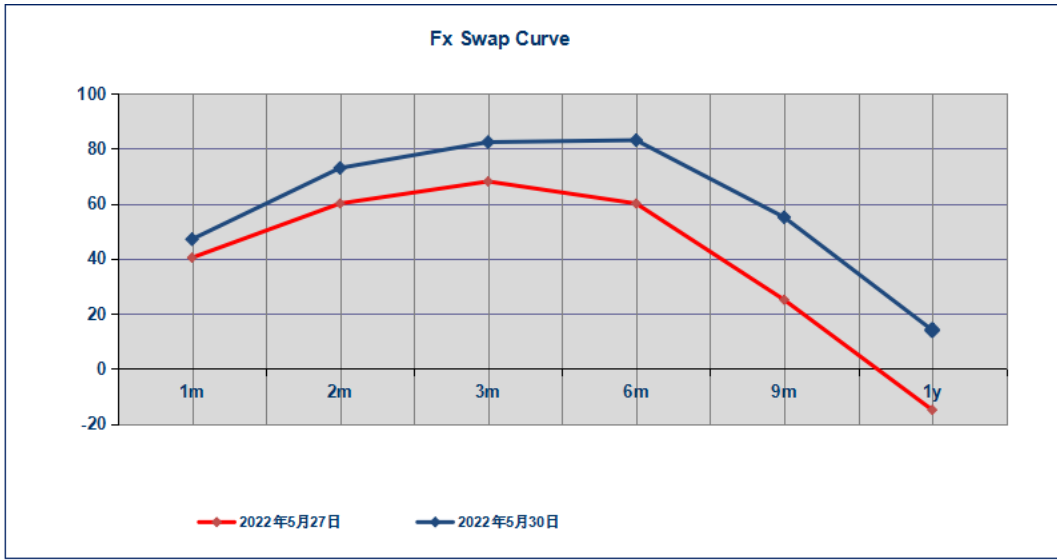
今日无 ON；TN 从+5.2 一路买到过+5.4、+6、+6.09、+6.5；SN 成交在+1.29~+1.3 之间。1S 成交在+46.5，尾盘收在+47 附近；2S 收在+73 附近；3S 收在+82 附近。

中长期限，6S 收在+83 附近；9S 成交在+55；1Y 成交+10、+12、+17。

Spread 方面，2*3S 成交在+11。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	9	6.6657	-3.02
2W	14	19	6.6667	-4
1M	30	47	6.6695	6.7
2M	61	73	6.6721	13
3M	92	82	6.6730	14.3
6M	183	83	6.6731	23
9M	273	55	6.6703	30
1Y	365	14	6.6662	29
18M	548	-30	6.6618	30
2Y	733	-85	6.6563	33
3Y	1097	-75	6.6573	45
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7048	
CLOSING SPOT RATE			6.6648	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	25.9	35.3	36	8	-33
2M		9.4	10.1	-17.9	-58.9
3M			0.7	-27.3	-68.3
6M				-28	-69
9M					-41



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