

# 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

**【2022-05-20】**

今日美元/人民币中间价报 6.7487, 较上一交易日下调 37bp, 大部分期限收盘价较上一交易日略微有所上升。

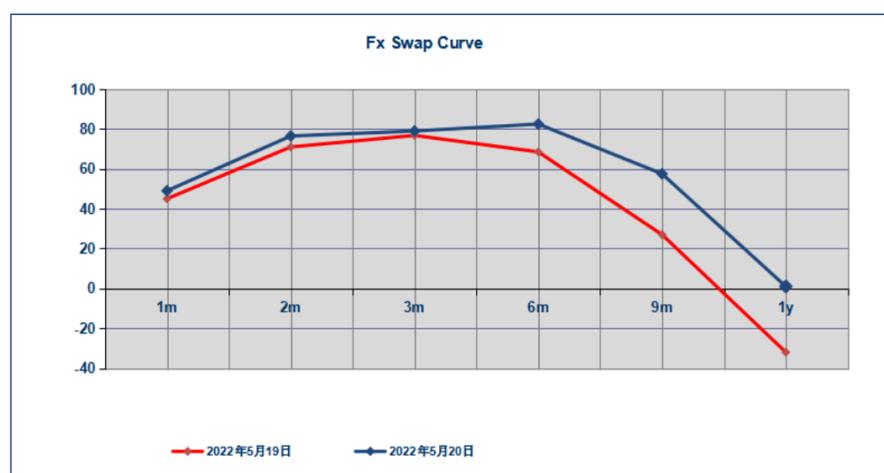
ON 主要成交在+3.5~+3.8 附近; TN 主要成交在+1.25~+1.4 之间; SN 主要成交在+1.2~+1.5 之间; 1w 主要成交在+10.5, +10.8, +11 附近的位置; 2w 成交在+24, +27 附近的位置; 1s 成交在+50, +51 附近。2s 成交在+75 附近的位置; 3s 成交在+78, +82 等位置。

6s 主要成交再+80, +82, +85 附近的位置。9s 成交在+45, +50, +57, +52 附近。1y 成交在-25, -15, -10, -5, +2, -7 附近的位置。

Spread 方面, 3s\*6s 成交在+3 的位置

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	11	6.6751	-0.34
2W	14	26	6.6766	4
1M	31	49	6.6789	4
2M	62	77	6.6817	6
3M	92	79	6.6819	2.2
6M	185	83	6.6823	14
9M	276	58	6.6798	30.5
1Y	365	1	6.6741	33
18M	549	-100	6.6640	30
2Y	731	-170	6.6570	20
3Y	1099	-200	6.6540	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7487	
CLOSING SPOT RATE			6.6740	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	27.5	30	33.5	8.5	-48
2M		2.5	6	-19	-75.5
3M			3.5	-21.5	-78
6M				-25	-81.5
9M					-56.5



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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)