

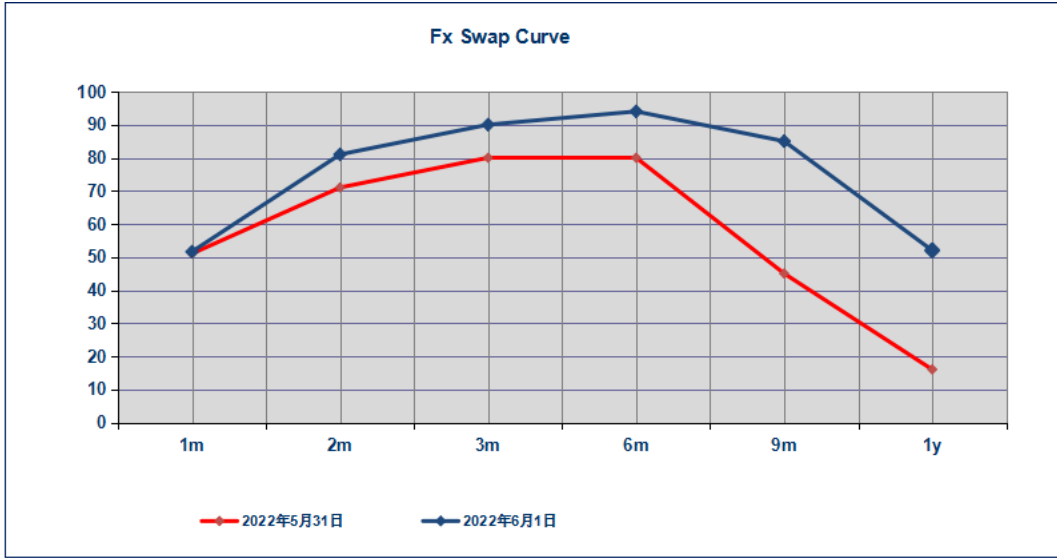


【2022-06-01】

今日美元/人民币中间价报 6.6651，较上一个交易日上调 44bp，各期限收盘价较上一交易日上行。  
ON 从+1.36 一路买到+1.7；TN 从+5.35 一路买到+6.29；SN 从+1.37 一路买到+1.64。1S 成交在+52~+53.5 之间；3S 成交在+90 附近。  
中长期限，6S 成交在+95 附近，1Y 从+35 买到过+50、+60。  
超长期限，18S 成交在 par。  
Spread 方面，12\*18S 成交在+60；2Y\*3Y 成交在 par。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 7    | 12         | 6.6953       | 2.05       |
| 2W                      | 15   | 22         | 6.6963       | 3          |
| 1M                      | 30   | 52         | 6.6993       | 0.6        |
| 2M                      | 63   | 81         | 6.7022       | 10         |
| 3M                      | 92   | 90         | 6.7031       | 10         |
| 6M                      | 183  | 94         | 6.7035       | 14         |
| 9M                      | 273  | 85         | 6.7026       | 40         |
| 1Y                      | 365  | 52         | 6.6993       | 36         |
| 18M                     | 548  | 0          | 6.6941       | 30         |
| 2Y                      | 731  | -20        | 6.6921       | 50         |
| 3Y                      | 1096 | -20        | 6.6921       | 40         |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 6.6651       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 6.6941       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |      |      |      |      |     |
|---------------------|------|------|------|------|-----|
|                     | 2M   | 3M   | 6M   | 9M   | 1Y  |
| 1M                  | 29.4 | 38.4 | 42.4 | 33.4 | 0.4 |
| 2M                  |      | 9    | 13   | 4    | -29 |
| 3M                  |      |      | 4    | -5   | -38 |
| 6M                  |      |      |      | -9   | -42 |
| 9M                  |      |      |      |      | -33 |



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