



【2022-05-25】

今日美元/人民币中间价报 6.6550，较上一交易日下调 16bp，全天掉期市场交投较为活跃。

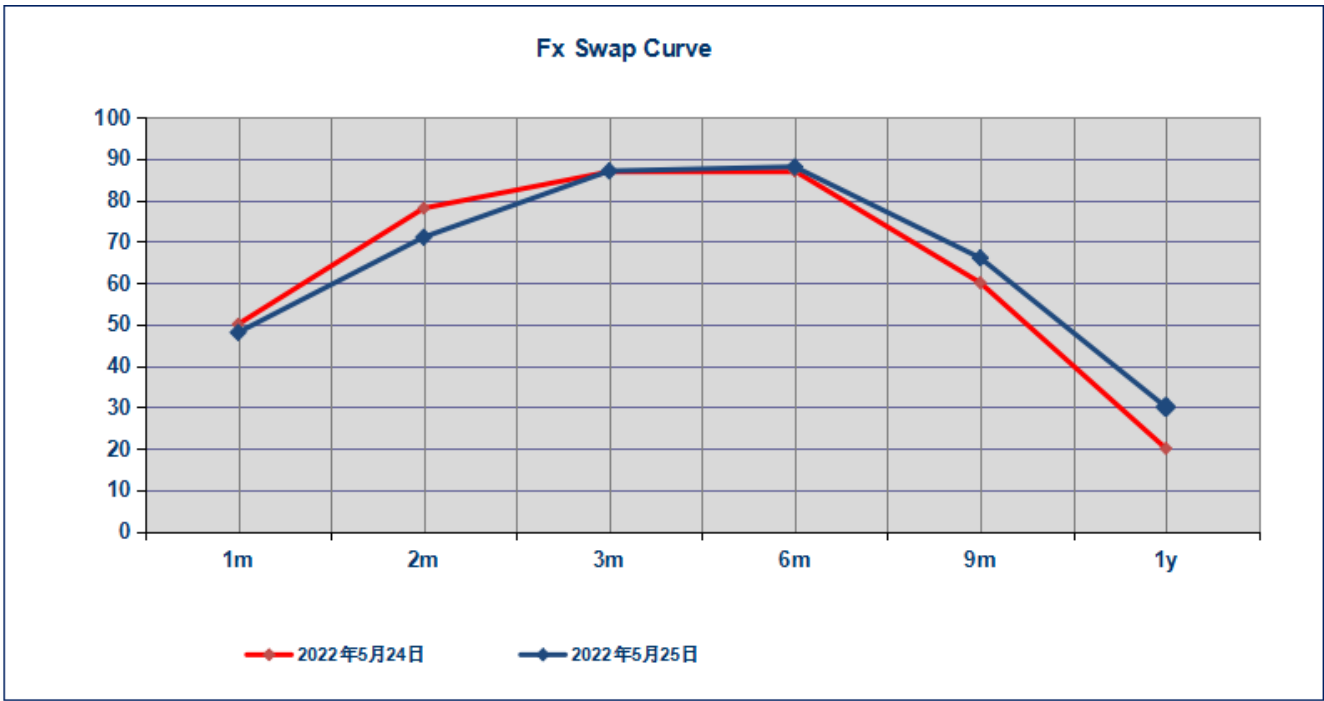
O/N 主要成交在+1~+1.28； T/N 主要成交在+1.2~+1.37； S/N 主要成交在+5.49~+5.53； 1w 成交在+19.8~+20.5； 1s 成交在+51； 3s 成交在+88， +90。

中长期限， 6s 成交在+90； 9s 主要成交在+70； 1y 主要成交在+40； 2y 成交在-60；

Spread， 3s*6s 成交在+2； 9s*1y 成交在-30。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	10	20	6.6757	3.3
2W	14	27	6.6764	1
1M	31	48	6.6785	-2
2M	61	71	6.6808	-7
3M	94	87	6.6824	0.2
6M	185	88	6.6825	1
9M	276	66	6.6803	6
1Y	368	30	6.6767	10
18M	549	-20	6.6717	0
2Y	732	-60	6.6677	0
3Y	1096	-60	6.6677	30
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.6550	
CLOSING SPOT RATE			6.6737	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	23	39	40	18	-18
2M		16	17	-5	-41
3M			1	-21	-57
6M				-22	-58
9M					-36



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