



【2022-05-23】

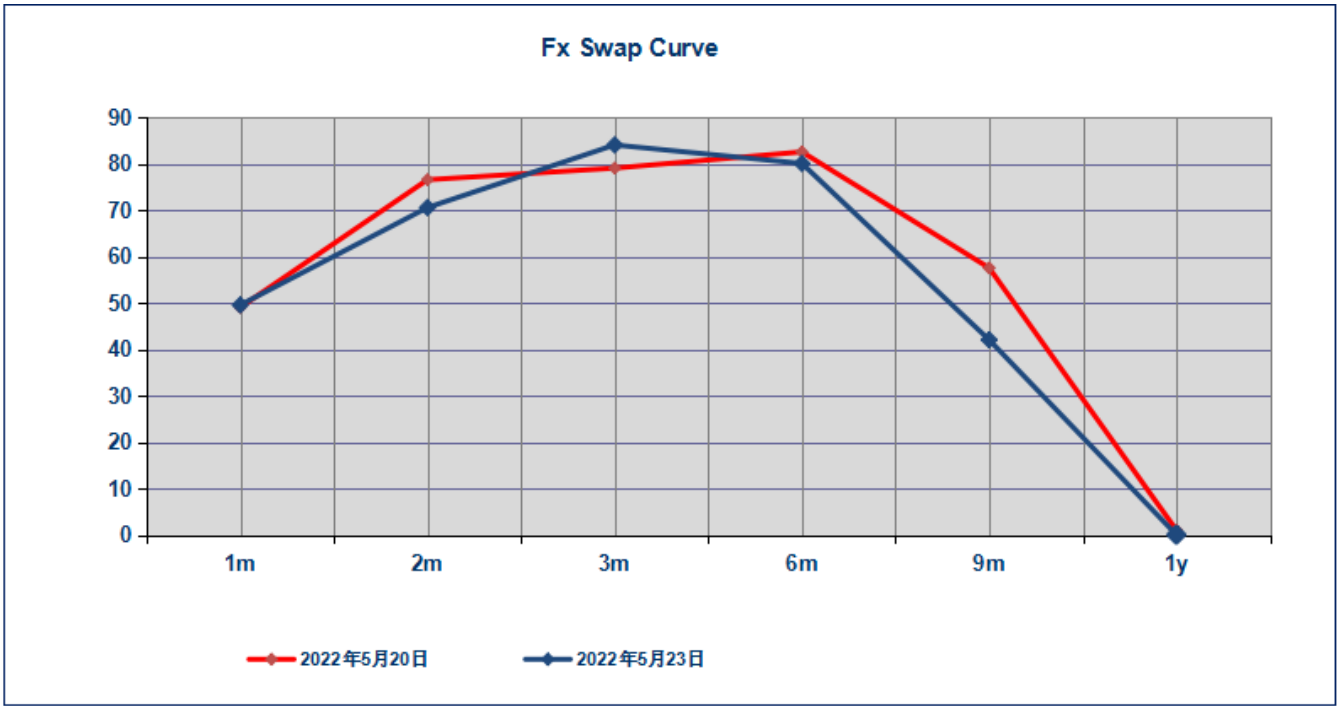
今日美元/人民币中间价报 6.6756，较上一交易日下调 731bp，全天掉期市场交投较为活跃。

O/N 主要成交在+1.3~+1.4；T/N 主要成交在+1.27~+1.32；S/N 主要成交在+1.3；1w 主要成交在+14.5,+14.88,+15；2s 成交在+71；3s 成交在+84。

中长期限，6s 成交在+80；1y 主要成交在-3~+7，；2y 成交在-100。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	15	6.6649	4.24
2W	14	25	6.6659	-1
1M	33	50	6.6684	0.5
2M	61	71	6.6705	-6
3M	92	84	6.6718	5
6M	184	80	6.6714	-3
9M	278	42	6.6676	-15.5
1Y	365	0	6.6634	-1
18M	551	-70	6.6564	30
2Y	734	-100	6.6534	70
3Y	1098	-110	6.6524	90
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.6756	
CLOSING SPOT RATE			6.6634	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	21	34.5	30.5	-7.5	-49.5
2M		13.5	9.5	-28.5	-70.5
3M			-4	-42	-84
6M				-38	-80
9M					-42



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