



【2022-05-18】

今日美元/人民币中间价报 6.7421，较上一交易日下调 433bp，大部分期限收盘价较上一交易日有所下降。

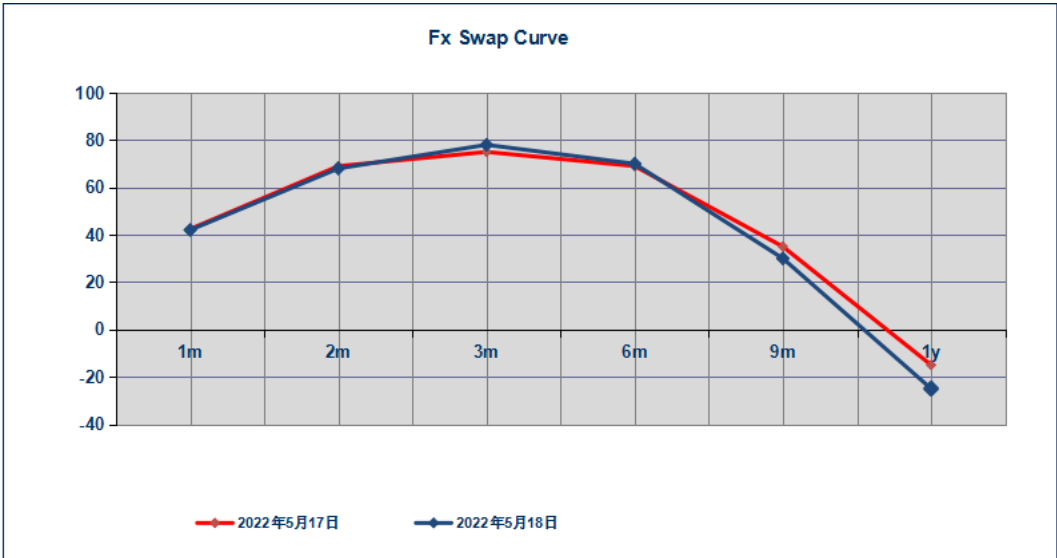
ON 主要成交在+1.1~+1.5 附近；TN 主要成交在+1.2~+1.4 之间；SN 主要成交在+3.8~+4.1 之间；1w 主要成交在+9~+10 之间，收在+9.5 附近的位置；1s 成交在+43.5, +43, +42, +44 附近。2s 成交在+68, +69 附近；3s 成交在+75, +76, +79 等位置。6s 主要成交在+72.5, +70, +65, +68 附近的位置。9s 成交在+37.5, +37, +30, +27, +25 附近。1y 成交在-15, -20, -22, -25 附近的位置。

超长方面，2y 成交在-165 的位置。

Spread 方面，1s*6s 成交在+29, +23 的位置；6s*9s 成交在-35 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	9	6.7499	0.31
2W	17	20	6.7510	-1
1M	32	42	6.7532	-0.4
2M	61	68	6.7558	-1
3M	94	78	6.7568	3
6M	185	70	6.7560	1
9M	277	30	6.7520	-5
1Y	367	-25	6.7465	-10
18M	549	-70	6.7420	0
2Y	731	-165	6.7325	5
3Y	1096	-190	6.7300	-20
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7421	
CLOSING SPOT RATE			6.7490	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	26	36	28	-12	-67
2M		10	2	-38	-93
3M			-8	-48	-103
6M				-40	-95
9M					-55



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