



【2022-11-07】

今日美元/人民币中间价报 7.2292，较上一个交易日下调 263bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-4.8~-4；T/N 成交在-4.45~-4；S/N 成交在-4.3~-4.2； 1w 成交在-30~-29.8；2w 成交在-62；1s 成交在-131.5~-130；2s 成交在-306，-305；3s 成交在-495~-491。

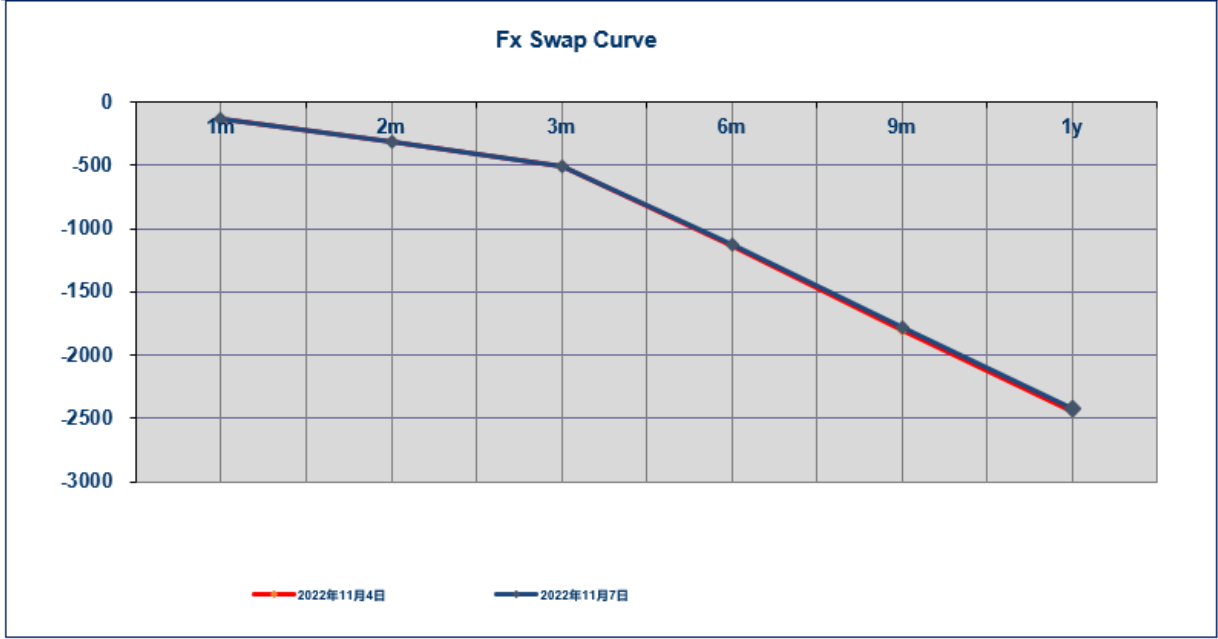
中长期限，6s 成交在-1119；1Y 成交在-2418~-2375。

超长期限，2Y 成交在-4100。

Spread 方面，无。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-31	7.2374	-0.76
2W	14	-61	7.2344	0
1M	30	-132	7.2273	0
2M	61	-312	7.2093	3
3M	92	-504	7.1901	4
6M	181	-1130	7.1275	14
9M	273	-1787	7.0618	18
1Y	365	-2425	6.9980	20
18M	547	-3520	6.8885	30
2Y	734	-4200	6.8205	30
3Y	1097	-5150	6.7255	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.2292	
CLOSING SPOT RATE			7.2405	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-180	-372	-998	-1655	-2293
2M		-192	-818	-1475	-2113
3M			-626	-1283	-1921
6M				-657	-1295
9M					-638



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