



【2022-11-21】

今日 Fixing 定在 7.1256，较上一交易日上调了 165 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 成交在-4.6~-6。T/N 成交在-4.5~-7。S/N 成交在-9.25~-9.4。1w 成交在-32.8，-32.82 的位置；2w 成交在-70 的位置。

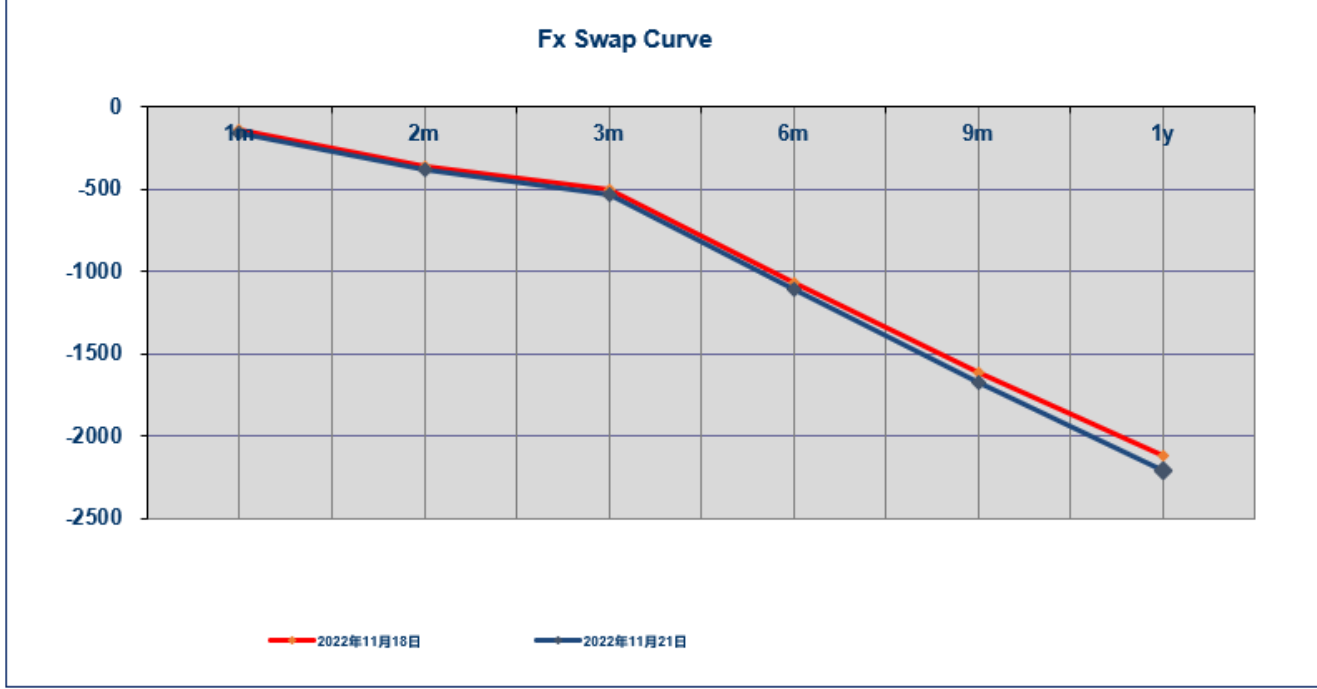
1s 开盘成交在-147.9 的位置，随后反复成交在-148，-160，-161 的位置，尾盘收在-162 附近；2s 成交在-382 的位置；3s 反复成交在-525 的位置。

中长期限，6s 反复成交在-1110 的位置。1y 在-2213，-2230 等位置成交。18s 成交在-2900 的位置。

Spread 上，2w*1s 成交在-90 的位置。1s*2s 成交在-220 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-37	7.1593	-5.9
2W	14	-70	7.1560	-7
1M	30	-163	7.1468	-20.5
2M	68	-383	7.1247	-17
3M	92	-535	7.1095	-26
6M	181	-1112	7.0518	-42
9M	273	-1674	6.9956	-54
1Y	366	-2215	6.9415	-95
18M	547	-2975	6.8655	-187
2Y	733	-3435	6.8195	-195
3Y	1097	-3750	6.7880	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1256	
CLOSING SPOT RATE			7.1630	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-220.5	-372.5	-949.5	-1511.5	-2052.5
2M		-152	-729	-1291	-1832
3M			-577	-1139	-1680
6M				-562	-1103
9M					-541



文 / Ray Yan

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