



【2022-11-08】

今日 Fixing 定在 7.2150，较上一交易日下调了 142 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-4.7~-4.9。T/N 成交在-4.5~-4.78。S/N 成交在-18.15~-18.8。1w 反复成交在-32，-32.3，-32.5 的位置；2w 成交在-70 的位置。

1s 成交在-144，-145，-147 的位置；2s 成交在-327 的位置；3s 成交在-533 的位置。

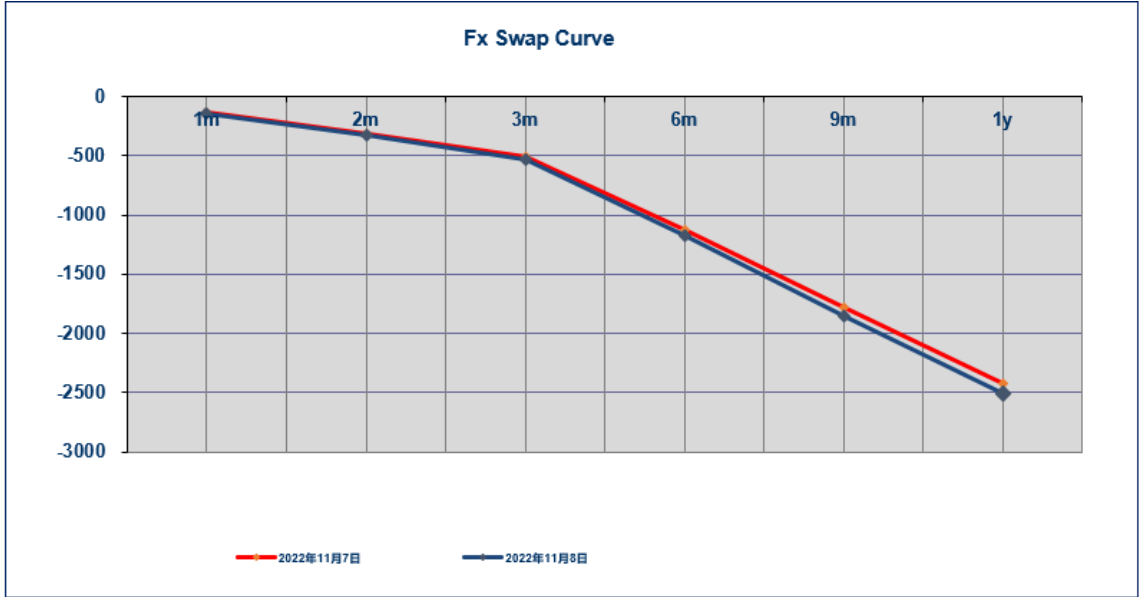
中长期，6s 成交在-1181，-1185 的位置。9s 反复成交在-1835 的位置。1y 在-2505，-2510，-2515，-2522 等位置成交，尾盘收在-2510 附近。

2y 反复成交在-4250，-4270 的位置。3y 成交在-5300 的位置。

Spread 上，1w*2w 反复成交在-38.8 的位置；2w*3w 成交在-25 的位置；2w*1s 成交在-75 的位置；3w*1s 反复成交在-51 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	7.2587	-2.64
2W	15	-71	7.2549	-10
1M	32	-147	7.2473	-15
2M	61	-327	7.2293	-15
3M	92	-531	7.2089	-27
6M	181	-1180	7.1440	-50
9M	273	-1856	7.0764	-69
1Y	365	-2510	7.0110	-85
18M	547	-3600	6.9020	-80
2Y	733	-4300	6.8320	-100
3Y	1096	-5300	6.7320	-150
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.2150	
CLOSING SPOT RATE			7.2620	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-180	-384	-1033	-1709	-2363
2M		-204	-853	-1529	-2183
3M			-649	-1325	-1979
6M				-676	-1330
9M					-654



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