



【2022-11-04】

今日 Fixing 定在 7.2555，较上一交易日上调了 83 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上涨。

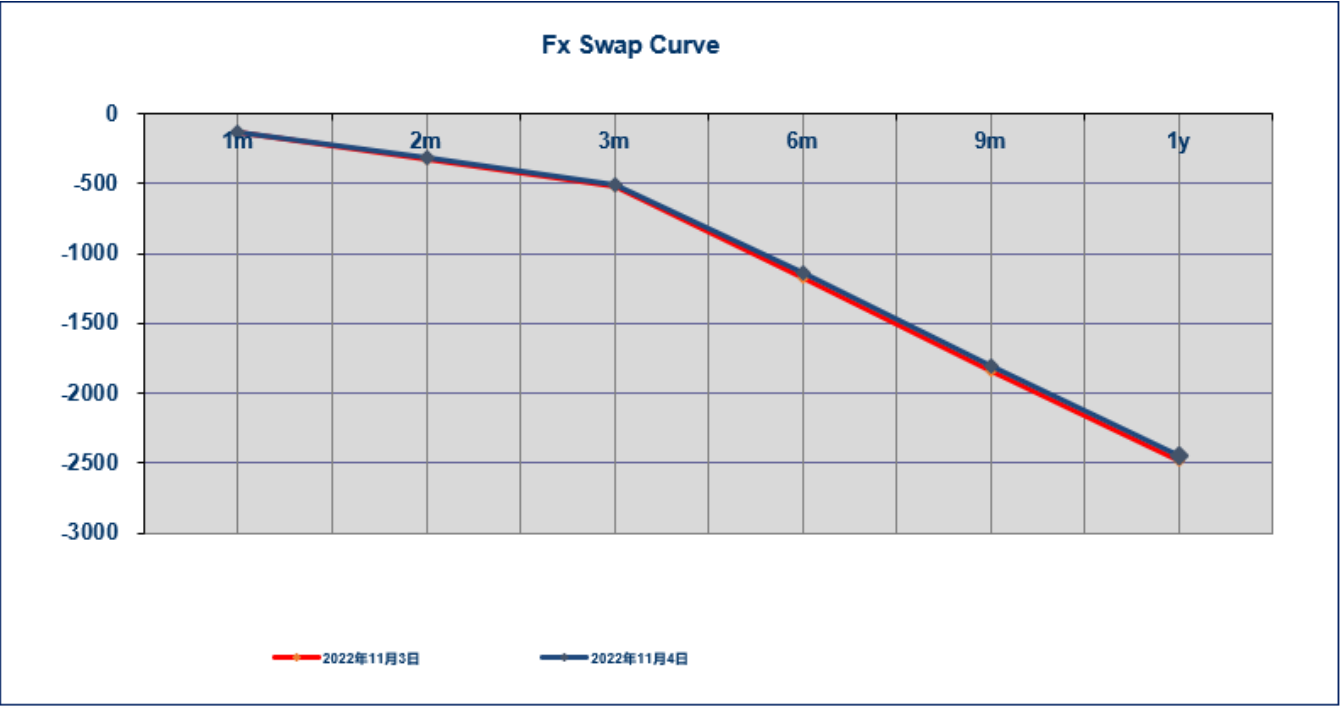
短端，O/N 成交在-11~-10.5。T/N 成交在-3.9~-3.8。S/N 成交在-4.3~-4。1w 成交在-30.5~-29.8。1s 成交在-134.5~-132。2s 成交在-320~-315。3s 成交在-520~-505，尾盘收在-508。

中长期限，6s 成交在-1185~-1140。9s 成交在-1850，-1840，-1830，-1810，-1805。1y 成交在-2490~-24220，尾盘收在-2440。

Spread 上，6*12s 成交在-1295。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-30	7.2673	1.2
2W	14	-61	7.2642	2
1M	30	-132	7.2571	6
2M	62	-315	7.2388	15
3M	92	-508	7.2195	12
6M	181	-1144	7.1559	31
9M	273	-1805	7.0898	40
1Y	365	-2445	7.0258	45
18M	547	-3550	6.9153	50
2Y	731	-4230	6.8473	40
3Y	1098	-5150	6.7553	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.2555	
CLOSING SPOT RATE			7.2703	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-183	-376	-1012	-1673	-2313
2M		-193	-829	-1490	-2130
3M			-636	-1297	-1937
6M				-661	-1301
9M					-640



文 / Jason Ge

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