



【2022-11-17】

今日 Fixing 定在 7.0655，较上一交易日上调了 292 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅下调。

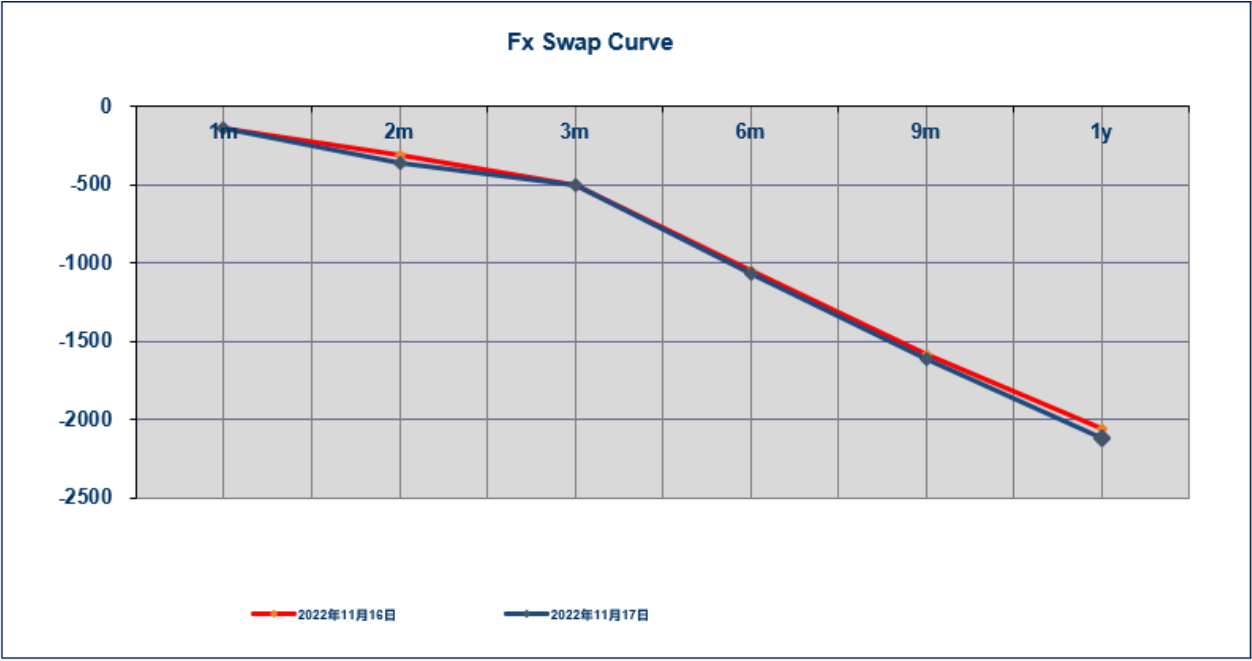
短端，O/N 成交在-4.4~-4。T/N 成交在-13.7~-12.5。S/N 成交在-4.42~-4.1。1w 成交在-31~-30.6。2w 成交在-61.6~-60.5。1s 成交在-142~-140。2s 成交在-363~-360。3s 成交在-506~-491，尾盘收在-505。

中长期限，6s 成交在-1065~-1037，尾盘收在-1065。9s 成交在-1585，-1581。1y 成交在-2125~-2077，尾盘收在-2120。

Spread 上，1w*2w 成交在-30。2*3s 成交在-140。6*12s 成交在-1832。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-31	7.1260	-2
2W	14	-62	7.1229	-2
1M	30	-142	7.1150	-0.5
2M	70	-363	7.0928	-50
3M	92	-504	7.0787	5
6M	182	-1070	7.0221	-15
9M	273	-1619	6.9672	-34
1Y	365	-2125	6.9166	-64
18M	547	-2800	6.8491	-75
2Y	731	-3275	6.8016	-145
3Y	1096	-3950	6.7341	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0655	
CLOSING SPOT RATE			7.1291	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-221.5	-362.5	-928.5	-1477.5	-1983.5
2M		-141	-707	-1256	-1762
3M			-566	-1115	-1621
6M				-549	-1055
9M					-506



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