



【2022-11-25】

今日 Fixing 定在 7.1339，较上一交易日上调了 138 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-17.7~-17。T/N 成交在-5.8~-5.5。S/N 成交在-5.85~-5.45。1w 成交在-38~-37.5。2s 成交在-359~-356。3s 成交在-537~-533，尾盘收在-538。

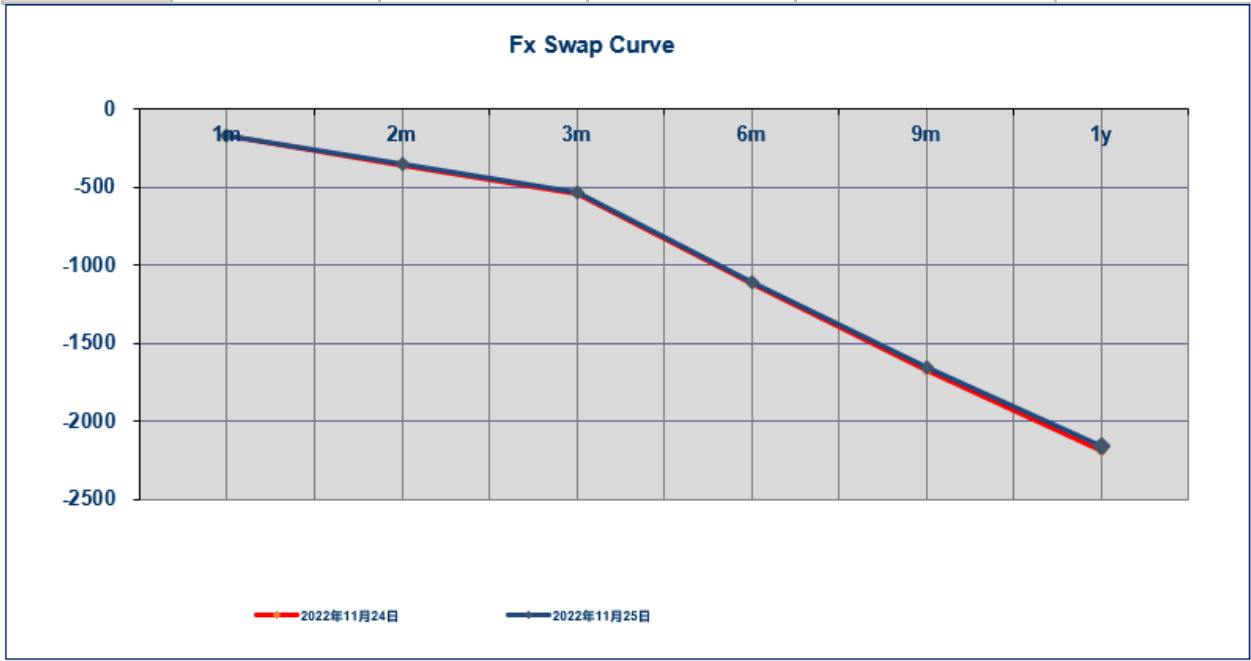
中长期限，6s 成交在-1115~-1097，尾盘收在-1110。9s 成交在-1660。1y 成交在-2195~-2155，尾盘收在-2120，尾盘收在-2160。

长期限上，3y 成交在-3700，-3650。

Spread 上，3*6s 成交在-565。6*12s 成交在-1050。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-38	7.1578	-0.51
2W	14	-75	7.1540	-1
1M	30	-170	7.1445	-1
2M	62	-357	7.1258	4
3M	91	-539	7.1076	1
6M	182	-1110	7.0505	15
9M	273	-1660	6.9955	20
1Y	365	-2160	6.9455	34
18M	547	-2900	6.8715	0
2Y	731	-3330	6.8285	50
3Y	1095	-3650	6.7965	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1339	
CLOSING SPOT RATE			7.1615	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-187	-369	-940	-1490	-1990
2M		-182	-753	-1303	-1803
3M			-571	-1121	-1621
6M				-550	-1050
9M					-500



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