

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2022-11-16】

今日美元/人民币中间价报 7.0363, 较上一个交易日下调 58bp, 各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 成交在-3.3~-3 之间; TN 开盘从-4 买到-3.8; SN 成交在-11.82~-11.73 之间。1W 成交在-29.5~-28.5 之间; 2W 成交在-59.5~-58 之间。1S 成交在-140~-139 之间; 2S 在-312~-303 之间来回成交, 尾盘收在-312; 3S 在-508~-496 之间来回成交, 尾盘收在-508。

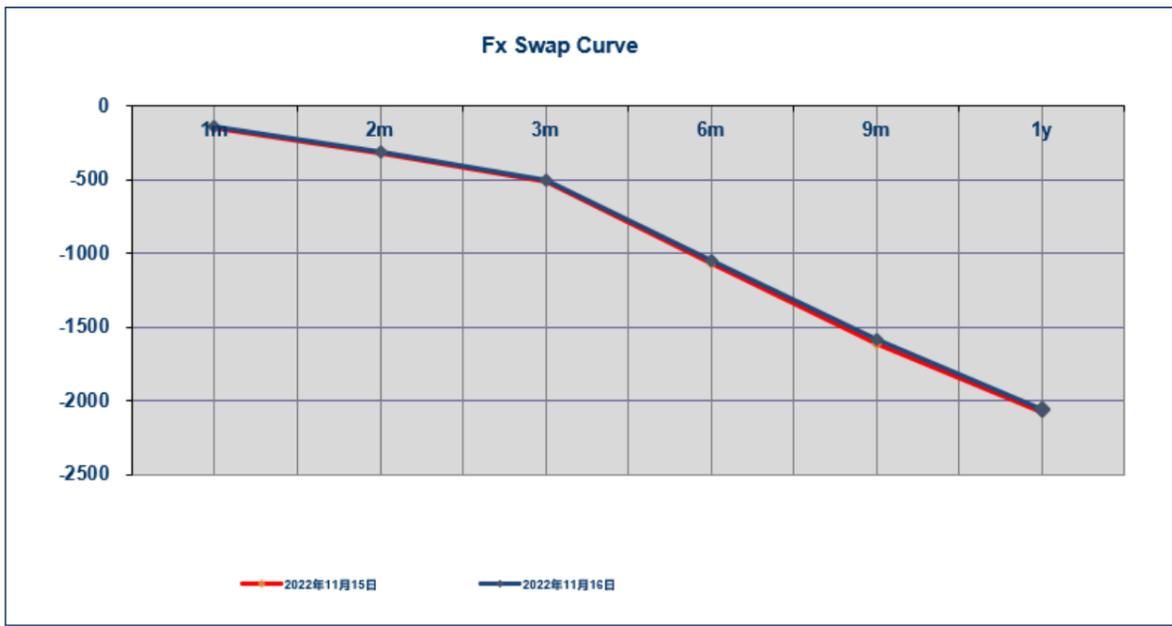
中长期限, 6S 从-1020 买到-1000, 后给回-1050; 9S 从-1550 买到-1510, 后给回-1560; 1Y 从-2030 一路买到-1975, 后给回-2060。

超长期限, 18S 成交在-2725, 2Y 成交在-3250、-3125、-3100。

Spread 方面, 1W\*2W 成交在-29.5, 2\*3S 成交在-194、-193.5, 3\*6S 成交在-515, 9\*12S 成交在-480、-470。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-29	7.0780	8.2
2W	14	-60	7.0750	5
1M	31	-141	7.0668	13
2M	61	-313	7.0496	13
3M	95	-509	7.0300	6
6M	181	-1055	6.9754	15
9M	273	-1585	6.9224	35
1Y	367	-2061	6.8748	19
18M	549	-2725	6.8084	175
2Y	731	-3130	6.7679	320
3Y	1096	-3900	6.6909	300
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0363	
CLOSING SPOT RATE			7.0809	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-172	-368	-914	-1444	-1920
2M		-196	-742	-1272	-1748
3M			-546	-1076	-1552
6M				-530	-1006
9M					-476



文 / Cathy He

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**