



【2022-11-29】

今日美元/人民币中间价报 7.1989，较上一个交易日上调 372bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-7.5~-5.75； T/N 成交在-5.9~-4.4； S/N 成交在-5.7~-5.4； 1w 成交在-38.5~-37.5； 1s 成交在 -180~-177.7； 3s 成交在-536~-525。

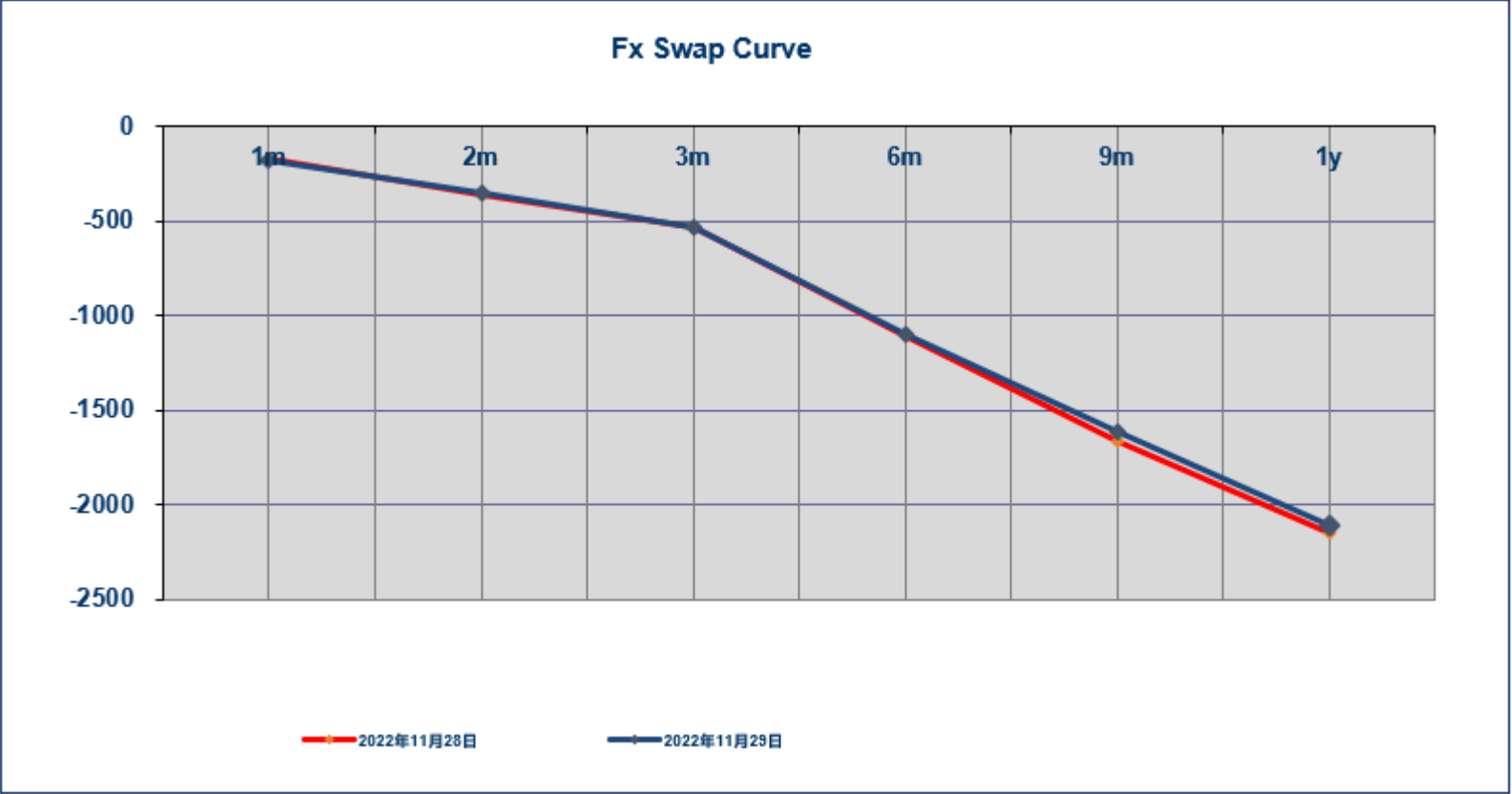
中长期限，6s 成交在-1090~-1065； 1Y 成交在-2123~-2080。

超长期限，3Y 成交在-3550。

Spread 方面，1w*3w 成交在-79； 1w*1s 成交在-139.4； 3w*1s 成交在-63， -60； 2s*3s 成交在-177； 6s*1y 成交在-1030， -1015。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-38	7.1625	-1
2W	14	-72	7.1591	6
1M	33	-179	7.1485	-8.5
2M	62	-358	7.1305	2
3M	90	-535	7.1128	1
6M	182	-1105	7.0558	5
9M	274	-1616	7.0047	49
1Y	365	-2110	6.9553	45
18M	550	-2850	6.8813	50
2Y	732	-3200	6.8463	100
3Y	1096	-3550	6.8113	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1989	
CLOSING SPOT RATE			7.1663	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-179.5	-356.5	-926.5	-1437.5	-1931.5
2M		-177	-747	-1258	-1752
3M			-570	-1081	-1575
6M				-511	-1005
9M					-494



文 / Edison Zeng

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