



【2022-11-15】

今日美元/人民币中间价报 7.0421，较上一个交易日下调 478bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-4.3~-3.7；T/N 成交在-4.77~-4；S/N 成交在-4.6； 1w 成交在-37.1~-36.8； 2w 成交在-65； 3w 成交在-98.5； 1s 成交在 -150； 2s 成交在-340~-320； 3s 成交在-532~-511。

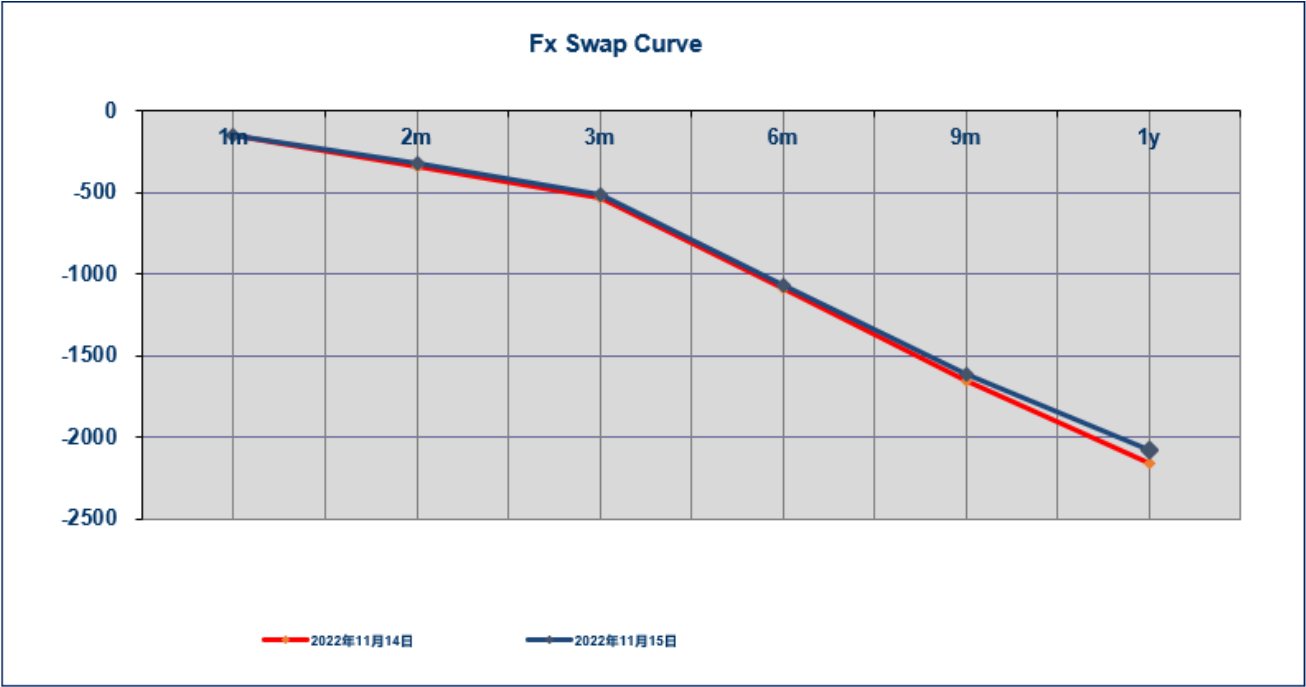
中长期限，6s 成交在-1105~-1088； 9s 成交在-1685~-1665； 1Y 成交在-2190~-2100。

超长期限，2Y 成交在-3475。

Spread 方面，1s*2s 成交在-176， -181； 2s*3s 成交在-191； 6s*9s 成交在-565； 6s*1y 成交在-1085。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	-37	7.0298	-3.8
2W	14	-65	7.0271	2
1M	32	-154	7.0181	-2
2M	61	-326	7.0009	14
3M	92	-515	6.9820	15
6M	181	-1070	6.9265	25
9M	273	-1620	6.8715	40
1Y	365	-2080	6.8255	84
18M	547	-2900	6.7435	100
2Y	732	-3450	6.6885	50
3Y	1096	-4200	6.6135	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0421	
CLOSING SPOT RATE			7.0335	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-172	-361	-916	-1466	-1926
2M		-189	-744	-1294	-1754
3M			-555	-1105	-1565
6M				-550	-1010
9M					-460



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