



【2022-11-30】

今日美元/人民币中间价报 7.1769，较上一个交易日下调 220bp，各期限收盘价较上一交易日略微下行。

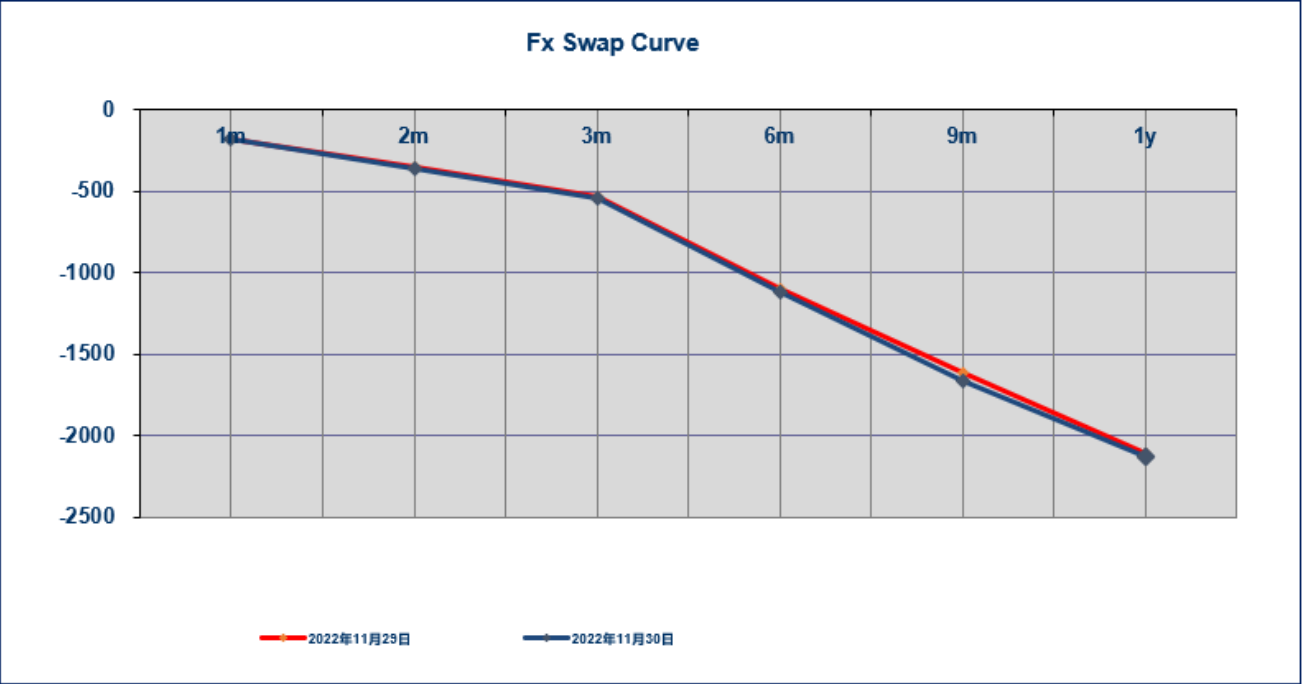
ON 成交在-5.8~-5 之间； TN 成交在 5.85~-5.69 之间； SN 成交在-16.98~-16.92 之间。 1W 成交在-39.2~-39 附近； 2W 成交在-77.7~-77.5 之间。 1S 成交在-176~-175 之间； 3S 成交在-544~-542 之间。

中长期限， 6S 成交在-1120~-1115 之间； 9S 成交在-1665~-1640 附近； 1Y 从-2110 给到-2140， 后买回-2135。

Spread 方面， 1W*2W 成交在-38.5， 2W*1S 成交在-97.3， 3W*1S 成交在-55， 2*3S 成交在-179。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.1380	-1.1
2W	14	-78	7.1341	-6
1M	32	-178	7.1242	1
2M	62	-363	7.1056	-5
3M	90	-542	7.0877	-7
6M	182	-1118	7.0301	-13
9M	277	-1663	6.9756	-47
1Y	367	-2126	6.9293	-16
18M	549	-2875	6.8544	-25
2Y	731	-3240	6.8179	-40
3Y	1096	-3550	6.7869	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1769	
CLOSING SPOT RATE			7.1419	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-185.5	-364.5	-940.5	-1485.5	-1948.5
2M		-179	-755	-1300	-1763
3M			-576	-1121	-1584
6M				-545	-1008
9M					-463



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