



【2022-11-10】

今日 Fixing 定在 7.2422，较上一交易日上升了 233 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端，O/N 主要成交在-17.9~-17 的位置。S/N 主要成交在-4.4~-4.25 的位置。1w 成交在-31.5， -31.2， -31.4 等位置。2w 成交在-63， -64 等位置。3w 成交在-95 的位置。1s 成交在-138， -137， -139， -140， -141 的位置。2s 成交在-345 等位置。3s 成交在-530， -532， -529， -528 等位置。

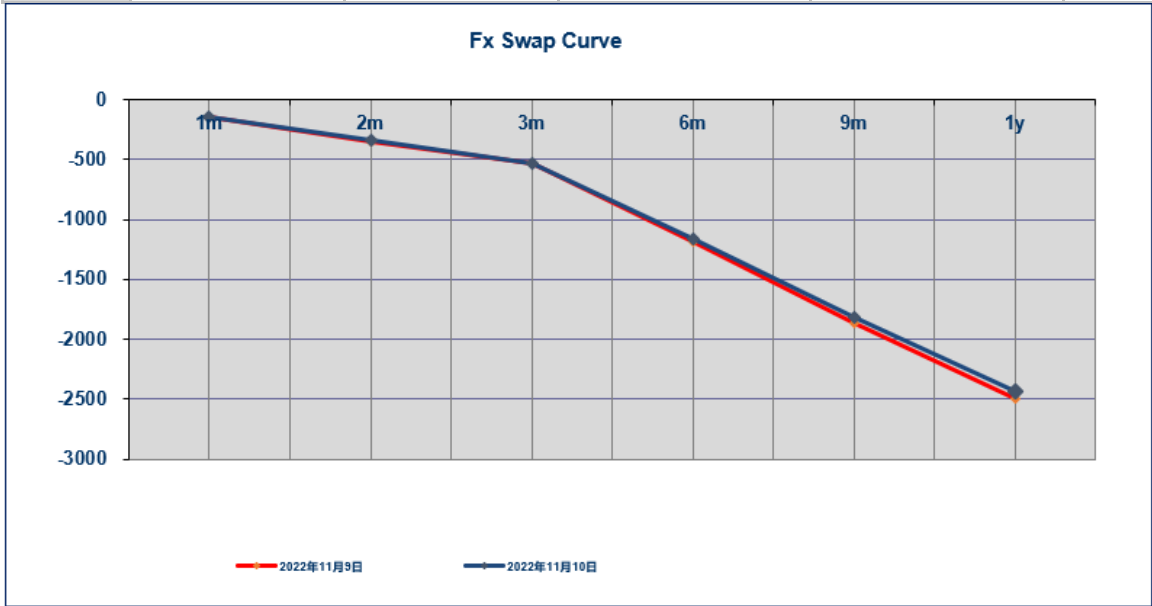
中长期，6s 成交在-1173， -1172， -1170， -1165， -1160， -1155 等位置。9s 成交在-1830， -1820， -1815， -1810 等位置。1y 成交在-2460， -2475， -2490， -2480， -2470， -2455， -2448， -2446， -2444 位置，最后收在-2440 的位置。

Spread 方面，1w*2w 成交在-32.5 的位置。2w*3w 成交在-32 的位置。1w*1s 成交在-105.5， -109.5 的位置。2w*1s 成交在-77 的位置。3w*1s 成交在-43， -44， -45 的位置。1*3s 成交在-389 的位置。3s*6s 成交在-636， -635 的位置。6*12s 成交在-1283 的位置。

超长期限，2y 成交在-4140 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-31	7.2443	1.3
2W	14	-64	7.2410	1
1M	30	-141	7.2333	2
2M	64	-345	7.2130	2
3M	92	-528	7.1946	7
6M	182	-1164	7.1311	22
9M	273	-1821	7.0653	49
1Y	365	-2441	7.0033	59
18M	547	-3550	6.8924	35
2Y	731	-4200	6.8274	90
3Y	1096	-5150	6.7324	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.2422	
CLOSING SPOT RATE			7.2474	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-203.5	-387	-1022.5	-1680	-2300
2M		-183.5	-819	-1476.5	-2096.5
3M			-635.5	-1293	-1913
6M				-657.5	-1277.5
9M					-620



文 / Yiff Wang

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