

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列

15th
CFETS-NEX
上海国际货币经纪15周年
CFETS-NEX 15th Anniversary 2007-2022

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2022-11-09】

今日美元/人民币中间价报 7.2189, 较上一个交易日上调 39bp, 各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 成交在-4.75~-4.68 之间; TN 从-18.2 给到-18.8; SN 成交在-4.85~-4.7 之间。1W 成交在-35~-33 之间; 2W 成交在-65.5 附近。1S 成交在-152~-143 之间, 尾盘收在-143; 2S 从-365 买到-345, 尾盘收在-345; 3S 成交在-546~-535 附近。

中长期, 6S 从-1215 买到-1210、-1188, 尾盘收在-1188; 9S 成交在-1880~-1870 附近; 1Y 从-2550 买到-2535、-2533、-2525、-2500。

超长期, 18S 成交在-3600.33。

Spread 方面, 1W*2W 成交在-35, 1*2S 成交在-213、-215, 1*3S 成交在-400。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	7.2347	0.7
2W	14	-65	7.2315	6
1M	30	-143	7.2237	4
2M	64	-346	7.2034	-19
3M	92	-535	7.1845	-4
6M	182	-1185	7.1195	-5
9M	273	-1870	7.0510	-14
1Y	365	-2500	6.9880	10
18M	547	-3585	6.8795	15
2Y	731	-4290	6.8090	10
3Y	1096	-5200	6.7180	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.2189	
CLOSING SPOT RATE			7.2380	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-203	-392	-1042	-1727	-2357
2M		-189	-839	-1524	-2154
3M			-650	-1335	-1965
6M				-685	-1315
9M					-630



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:

以上所提及的所有信息 (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