



【2022-11-11】

今日 Fixing 定在 7.1907，较上一交易日上调了 515 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上涨。

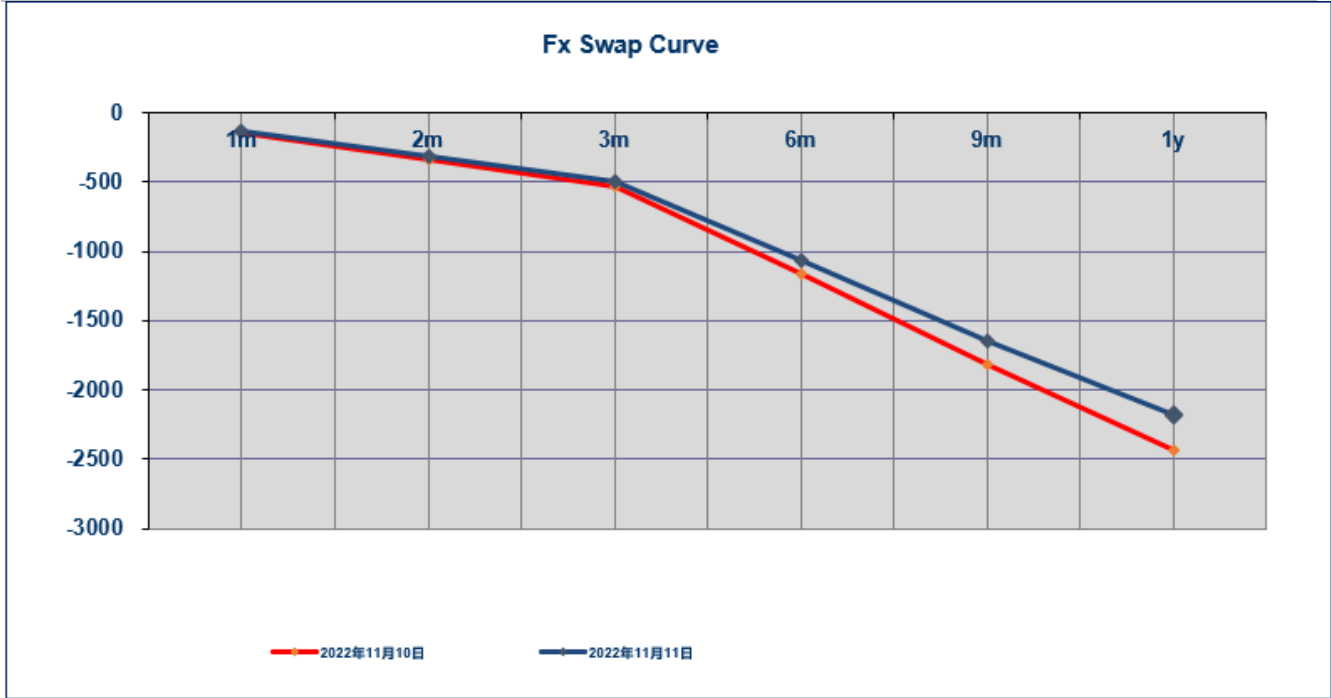
短端，T/N 成交在-4.35~-4.15。S/N 成交在-4.5~-4.25。1w 成交在-31~-30.5。2w 成交在-61.5。1s 成交在-138~-135。2s 成交在-328~-318。3s 成交在-505~-492，尾盘收在-500。

中长期，6s 成交在-1100~-1030。9s 成交在-1650。1y 成交在-2285~-2190，尾盘收在-2192。

Spread 上，2*3s 成交在-178，-180。3*6s 成交在-560。9*12s 成交在-550。6*12s 成交在-1130。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-31	7.1076	0.9
2W	14	-62	7.1045	3
1M	30	-137	7.0970	4.5
2M	63	-318	7.0788	27
3M	92	-495	7.0611	33
6M	181	-1064	7.0042	100
9M	273	-1650	6.9456	171
1Y	365	-2175	6.8931	266
18M	547	-3100	6.8006	450
2Y	731	-3400	6.7706	800
3Y	1098	-4350	6.6756	800
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1907	
CLOSING SPOT RATE			7.1106	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-181.5	-358.5	-927.5	-1513.5	-2038.5
2M		-177	-746	-1332	-1857
3M			-569	-1155	-1680
6M				-586	-1111
9M					-525



文 /Jason Ge

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