



【2022-11-22】

今日美元/人民币中间价报 7.1667，较上一个交易日上调 411bp，全天掉期市场交投较为活跃。

O/N 成交在-7~-5.9; T/N 成交在-13.8~-10.25; S/N 成交在-20~-16.5; 1w 成交在-40~-37.5; 2w 成交在-70; 3w 成交在-110; 1s 成交在 -180, -170; 3s 成交在-546。

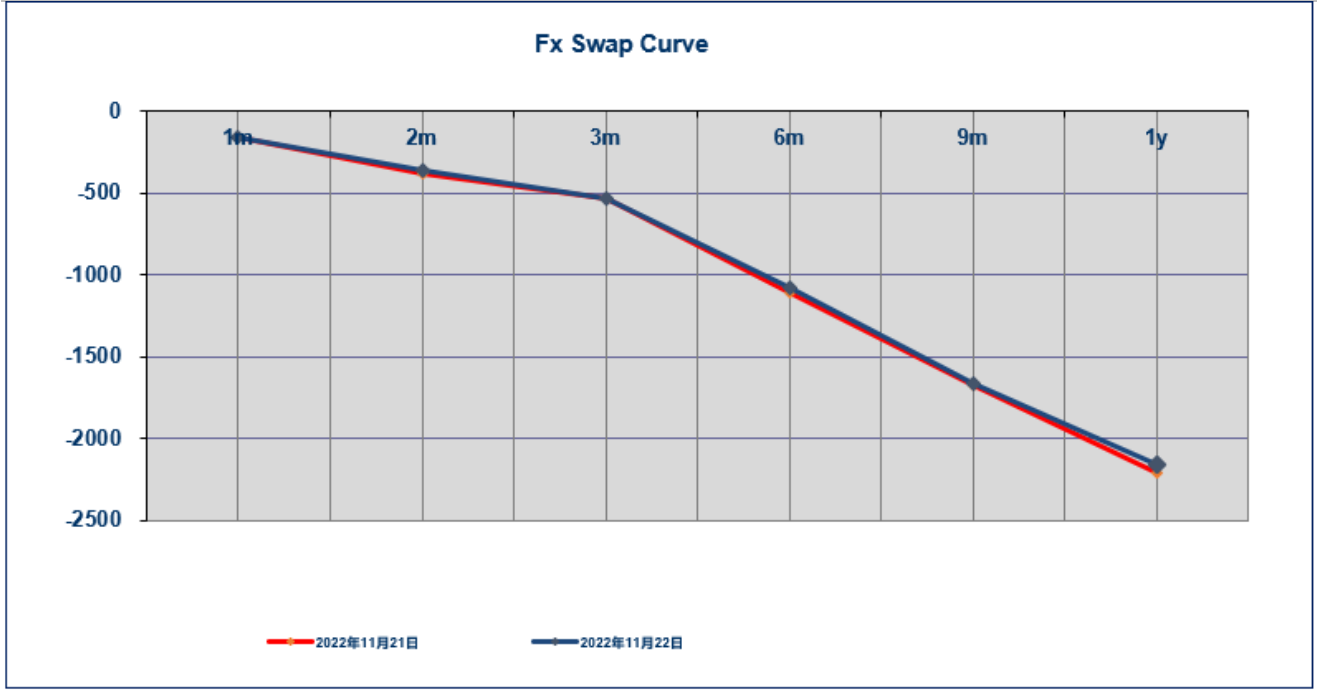
中长期限，1Y 成交在-2210~2175。

超长期限，2Y 成交在-3400。

Spread 方面，6s*1y 成交在-1107。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-36	7.1348	1
2W	14	-69	7.1315	1
1M	32	-166	7.1218	-3.5
2M	66	-366	7.1018	17
3M	94	-535	7.0849	0
6M	181	-1080	7.0304	32
9M	273	-1664	6.9720	10
1Y	367	-2165	6.9219	50
18M	550	-2862	6.8523	113.5
2Y	731	-3375	6.8009	60
3Y	1096	-3700	6.7684	50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1667	
CLOSING SPOT RATE			7.1384	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-200	-369	-914	-1498	-1999
2M		-169	-714	-1298	-1799
3M			-545	-1129	-1630
6M				-584	-1085
9M					-501



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