



【2022-11-28】

今日 Fixing 定在 7.1617，较上一交易日上调了 278 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端，O/N 成交在-6~-5.56。T/N 成交在-5.6~-5.55。S/N 成交在-5.5~-4.2。1w 成交在-40，-39.5，-39，-38.5，-38.4，-37 的位置；2w 成交在-79 的位置；3w 成交在-124 的位置。

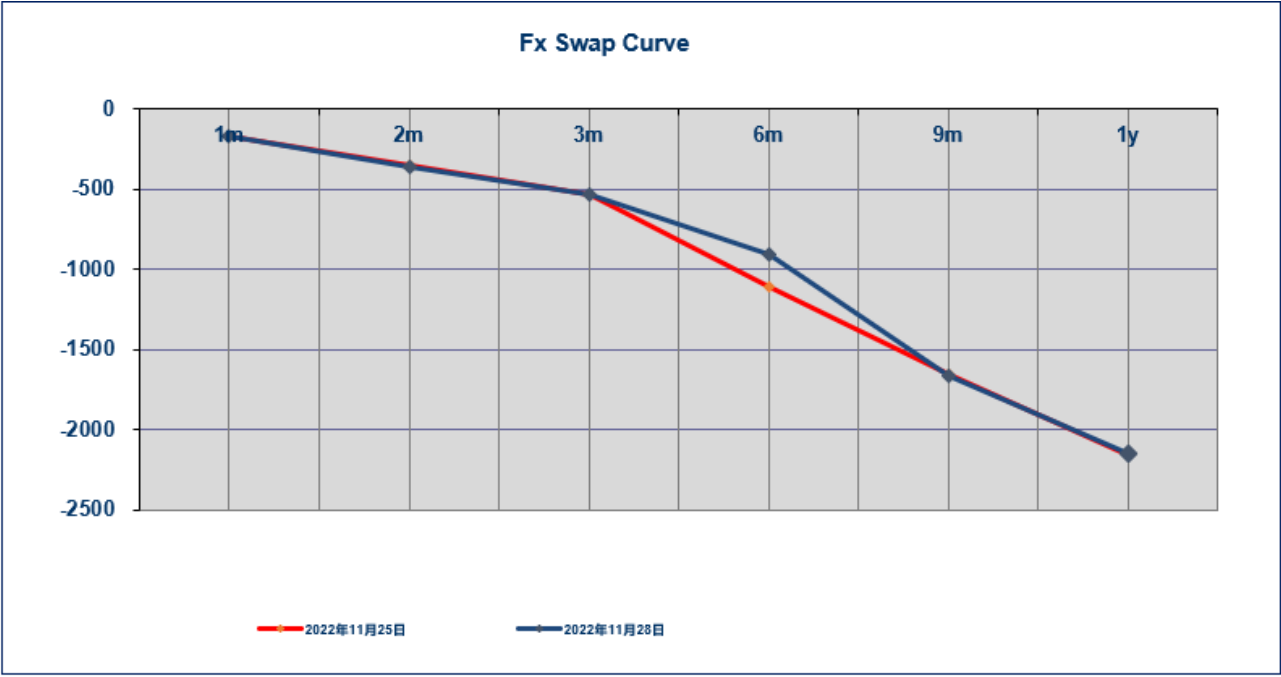
1s 成交在-172.5，-172，-171 的位置；3s 反复成交在-541，-540 的位置；4s 成交在-750 的位置。

中长期，6s 反复成交在-1130，-1120，-1115 的位置；3y 成交在-3720 的位置。

Spread 上，1w*2w 成交在-39.5 的位置；1w*3w 分别成交在-84，-83 的位置；3w*1s 成交在-52 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-37	7.1962	0.5
2W	14	-78	7.1922	-3
1M	30	-170	7.1829	0
2M	62	-360	7.1639	-3
3M	90	-536	7.1463	3
6M	182	-905	7.1094	205
9M	274	-1665	7.0334	-5
1Y	365	-2155	6.9844	5
18M	548	-2900	6.9099	0
2Y	730	-3300	6.8699	30
3Y	1094	-3650	6.8349	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1617	
CLOSING SPOT RATE			7.1999	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-190	-366	-735	-1495	-1985
2M		-176	-545	-1305	-1795
3M			-369	-1129	-1619
6M				-760	-1250
9M					-490



文 / Ray Yan

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