

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

【2022-12-08】

今日 Fixing 定在 6.9606, 较上一交易日下降了 369 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端, O/N 主要成交在-5.3~-4.8。T/N 主要成交在-16.25~-16.03 的位置。S/N 主要成交在-5.4~-5.28 的位置。1w 成交在-39, -39.15, -39.2, -39.5 等位置。1s 成交在-168, -84, -84.5, -85, -86, -86.5 的位置。3w 成交在-123 的位置。1s 成交在-171, -172, -172.5, -173, -174 的位置。2s 成交在-350, -351, -352 等位置。3s 成交在-520, -522, -523, -524, -525, -528, -530 等位置。

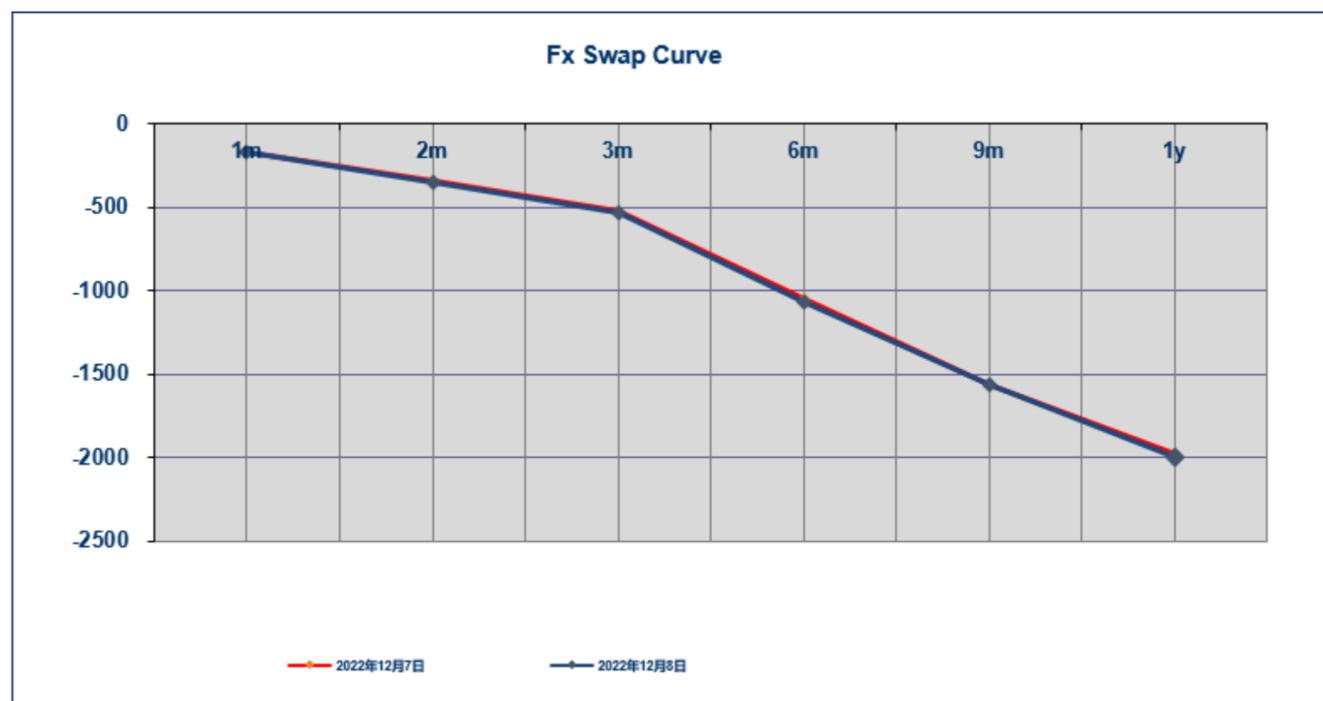
中长期限, 6s 成交在-1055, -1065, -1068, -1070, -1075 等位置。9s 成交在-1555, -1565, -1570 等位置。1y 成交在-1975, -1980, -1970, -1977, -1985, -1998, -2000 位置。

超长方面, 2y 成交在-2700 的位置。

Spread 方面, 1w*2w 成交在-46, -47 的位置。2w*1s 成交在-87, -88 的位置。3w*1s 成交在-5 的位置。3s*6s 成交在-540, -539 的位置。6s*12s 成交在-915, -914, -920, -930 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	6.9689	-1.9
2W	15	-86	6.9642	-10
1M	31	-174	6.9554	-2
2M	63	-351	6.9377	-8
3M	91	-532	6.9196	-11
6M	182	-1070	6.8658	-15
9M	274	-1570	6.8158	-5
1Y	365	-2000	6.7728	-22
18M	548	-2500	6.7228	0
2Y	731	-2750	6.6978	0
3Y	1096	-2800	6.6928	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9606	
CLOSING SPOT RATE			6.9728	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-177	-358	-896	-1396	-1826
2M		-181	-719	-1219	-1649
3M			-538	-1038	-1468
6M				-500	-930
9M					-430



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