

收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



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

【2022-11-18】

今日 Fixing 定在 7.1091，较上一交易日上升了 436 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-15.9~-14.5 的位置。T/N 主要成交在-4.5~-4.33 的位置。S/N 主要成交在-4.4~-4.34 的位置。1w 成交在-31.1, -31, -31.2, -31.14, -31 等位置。1s 成交在-145, -144, -143, -142, -142.5 的位置。2s 成交在-363 等位置。3s 成交在-513, -510, -508, -507 等位置。

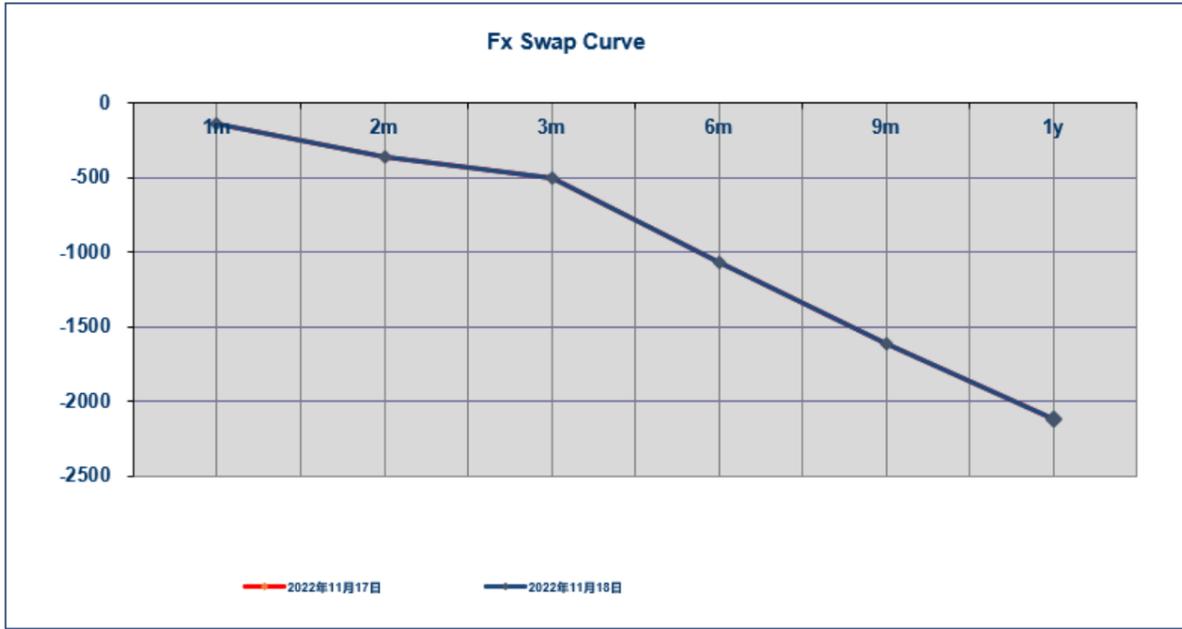
中长期，6s 成交在-1075, -1073, -1065, -1055, -1054, -1050, -1070 等位置。9s 成交在-1625, -1615, -1610, -1600, -1620 等位置。1y 成交在-2150, -2145, -2130, -2124, -2110, -2090, -2095, -2100 位置，最后收在-2120 的位置。

Spread 方面，6*12s 成交在-1072 的位置。

超长期限，18s 成交在-2770 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-31	7.1244	-0.5
2W	14	-64	7.1212	-2
1M	30	-142	7.1133	-0.5
2M	69	-366	7.0909	-3
3M	92	-509	7.0766	-5
6M	181	-1070	7.0205	0
9M	273	-1620	6.9655	-1
1Y	365	-2120	6.9155	5
18M	547	-2788	6.8487	12
2Y	731	-3240	6.8035	35
3Y	1098	-3750	6.7525	200
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1091	
CLOSING SPOT RATE			7.1275	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-224	-367	-928	-1478	-1978
2M		-143	-704	-1254	-1754
3M			-561	-1111	-1611
6M				-550	-1050
9M					-500



文 / Yiff Wang

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