



【2022-12-12】

今日 Fixing 定在 6.9565，较上一交易日下降了 23 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下调。

短端，O/N 成交在-5.3~-5。T/N 成交在-5.52~-5.3。S/N 成交在-5.5。1w 反复成交在-41，-41.3 的位置；2w 成交在-83，-82.5 的位置；3w 成交在-119，-118.5 的位置。

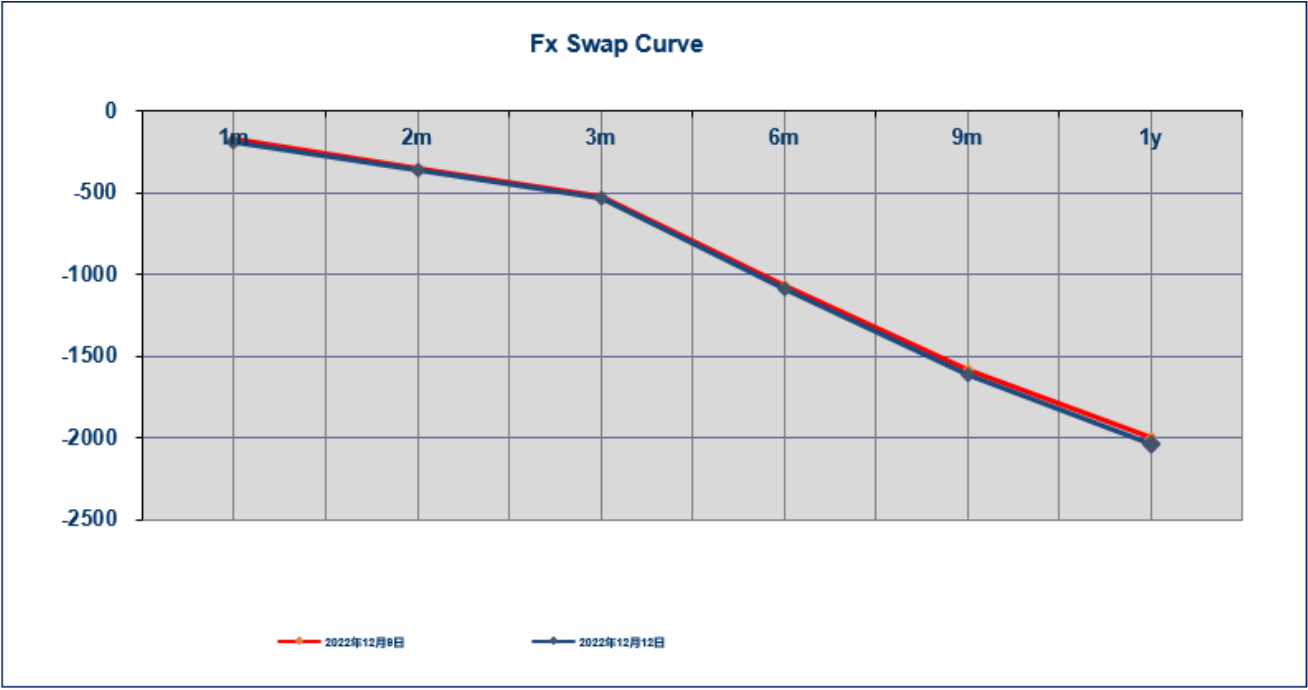
1s 成交在-192.5，-192，-191.5，-191 的位置；3s 反复成交在-533，-532.5，-532 的位置。

中长期限，6s 反复成交在-1089，-1085 的位置；1y 成交在-2029 的位置。

Spread 上，2w*1s 成交在-109 的位置；3w*1s 成交在-73.5 和-73 的位置；2s*3s 成交在-177.5 的位置；2s*6s 成交在-730 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	6.9716	-0.75
2W	14	-83	6.9674	-1
1M	34	-193	6.9564	-17.3
2M	62	-360	6.9397	-8
3M	90	-534	6.9223	-6
6M	182	-1088	6.8669	-13
9M	274	-1611	6.8146	-30
1Y	365	-2044	6.7713	-43
18M	548	-2550	6.7207	-50
2Y	733	-2800	6.6957	-50
3Y	1097	-2850	6.6907	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9565	
CLOSING SPOT RATE			6.9757	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-167	-341	-895	-1418	-1851
2M		-174	-728	-1251	-1684
3M			-554	-1077	-1510
6M				-523	-956
9M					-433



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