



【2022-12-05】

今日 Fixing 定在 7.0384，较上一交易日下降了 158 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端，O/N 成交在-5.5~-5.25。T/N 成交在-5.49。S/N 成交在-5.33。1w 反复成交在-37.2，-37.15 的位置；2w 成交在-76 的位置。

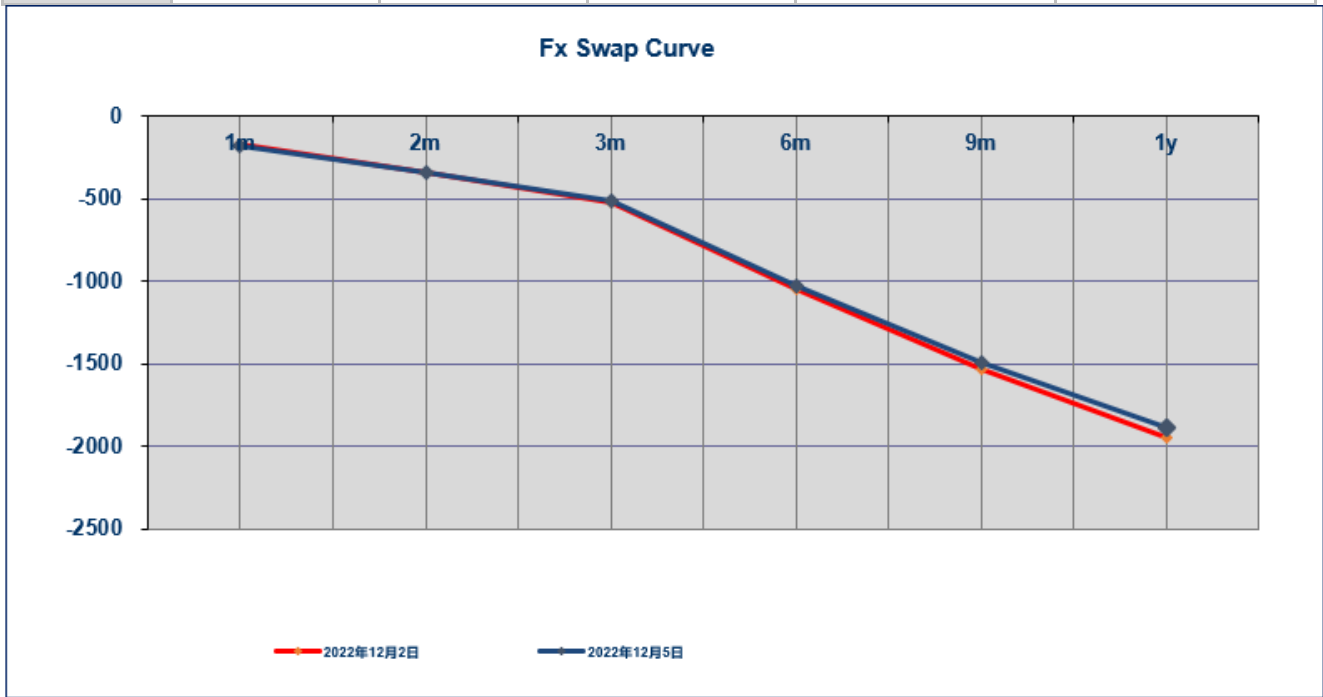
1s 成交在-180，-179，-177 的位置；2s 成交在-340，-339 的位置；3s 反复成交在-514，-512，-505 的位置。

中长期限，6s 成交在-1015，-1000，-995 的位置；9s 开盘成交在-1515 的位置，随后反复成交在-1470，-1465，-1460 的位置；1y 成交在-1905，-1890，-1875，-1869，-1865，-1860 的位置，尾盘收在-1900 附近。

Spread 上，1s*2s 成交在-160 的位置；2s*3s 成交在-172 的位置；6s*1y 成交在-890 的位置，9s*1y 成交在-400 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-37	6.9524	0.36
2W	14	-76	6.9485	0
1M	33	-177	6.9384	-6.5
2M	62	-339	6.9222	9
3M	90	-511	6.9050	9
6M	182	-1025	6.8536	24
9M	274	-1495	6.8066	35
1Y	365	-1885	6.7676	64
18M	548	-2435	6.7126	15
2Y	733	-2620	6.6941	130
3Y	1097	-2540	6.7021	342
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0384	
CLOSING SPOT RATE			6.9561	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-162	-334	-848	-1318	-1708
2M		-172	-686	-1156	-1546
3M			-514	-984	-1374
6M				-470	-860
9M					-390



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。