

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

【2022-11-14】

今日 Fixing 定在 7.0899，较上一交易日下调了 1008 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-3.8~-5。T/N 成交在-4.35~-4.9。S/N 成交在-4.4~-4.67。1w 反复成交在-31，-33 的位置；3w 成交在-94.5，-96.5，-97，-103 的位置。1s 开盘成交在-138 的位置，随后反复成交在-141，-142，-143，-146，-147 的位置，尾盘收在-151 的位置；2s 成交在-339 的位置；3s 反复成交在-505，-510，-520 的位置。

中长期，6s 成交在-1080，-1083，-1085，-1090 的位置。1y 在-2080，-2085，-2090，-2110，-2155 等位置成交，尾盘收在-2165 附近。18s 成交在-3000 的位置。

Spread 上，1w*2w 反复成交在-33.5 的位置；1w*3w 反复成交在-63.5 的位置；3w*1s 反复成交在-45,-45.5,-47 的位置。1s*2s 成交在-188 的位置；1s*3s 成交在-373 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	7.0345	-2.5
2W	14	-66	7.0312	-5
1M	30	-152	7.0226	-15.5
2M	62	-340	7.0038	-22
3M	92	-530	6.9848	-35
6M	181	-1095	6.9283	-31
9M	273	-1660	6.8718	-10
1Y	365	-2164	6.8214	11
18M	547	-3000	6.7378	100
2Y	733	-3500	6.6878	-100
3Y	1097	-4250	6.6128	100
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0899	
CLOSING SPOT RATE			7.0378	

USD/CNY Spread Ref.

2M

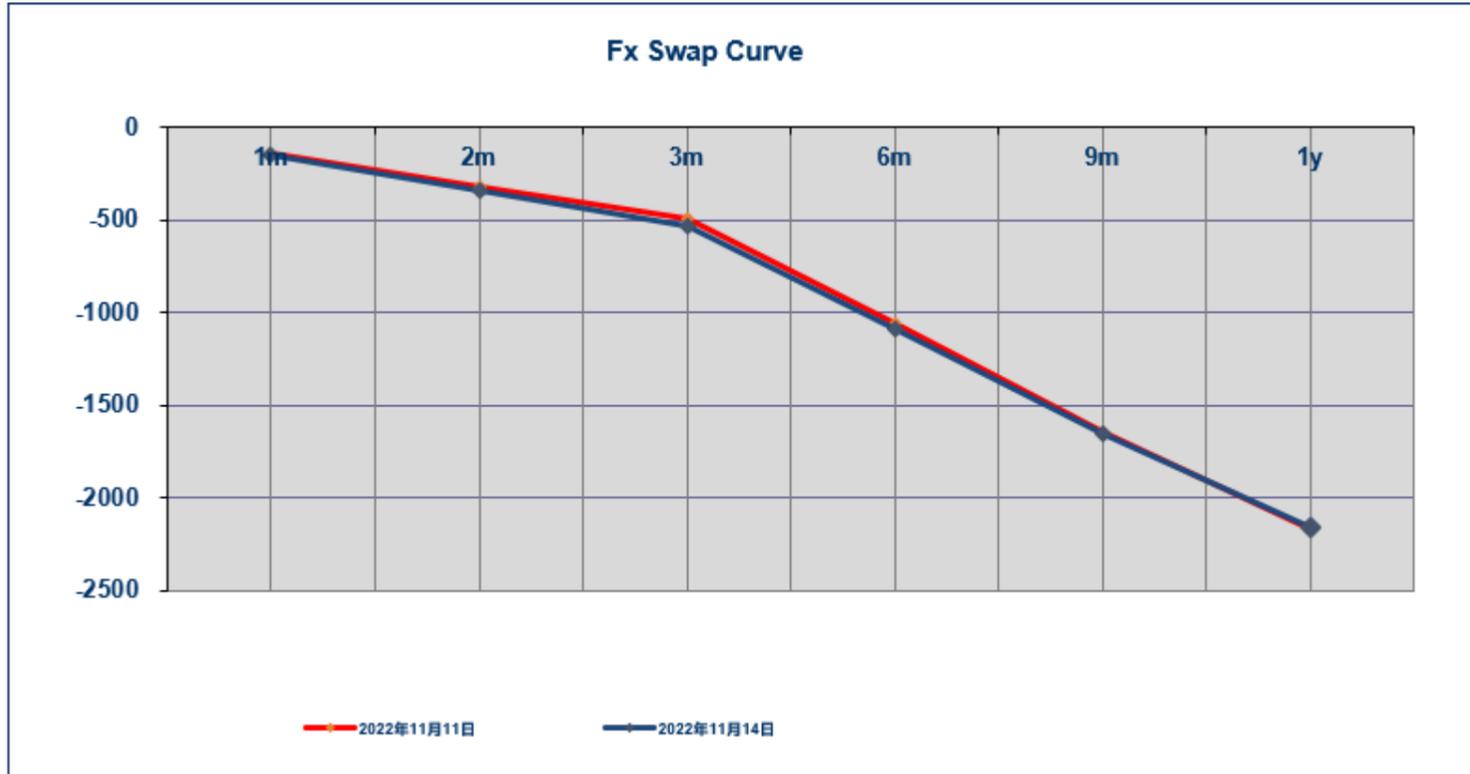
3M

6M

9M

1Y

1M	-188	-378	-943	-1508	-2012
2M		-190	-755	-1320	-1824
3M			-565	-1130	-1634
6M				-565	-1069
9M					-504



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:

以上所登及附加的所有信息 (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