



【2022-12-02】

今日 Fixing 定在 7.0542，较上一交易日下调了 683 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上涨。

短端，O/N 成交在-16~-15.4。T/N 成交在-5.6~-5.4。S/N 成交在-5.4~-5.27。1w 成交在-37.7~-37.6。1s 成交在-171~-169。2s 成交在-350~-347。3s 成交在-527~-521，尾盘收在-520。

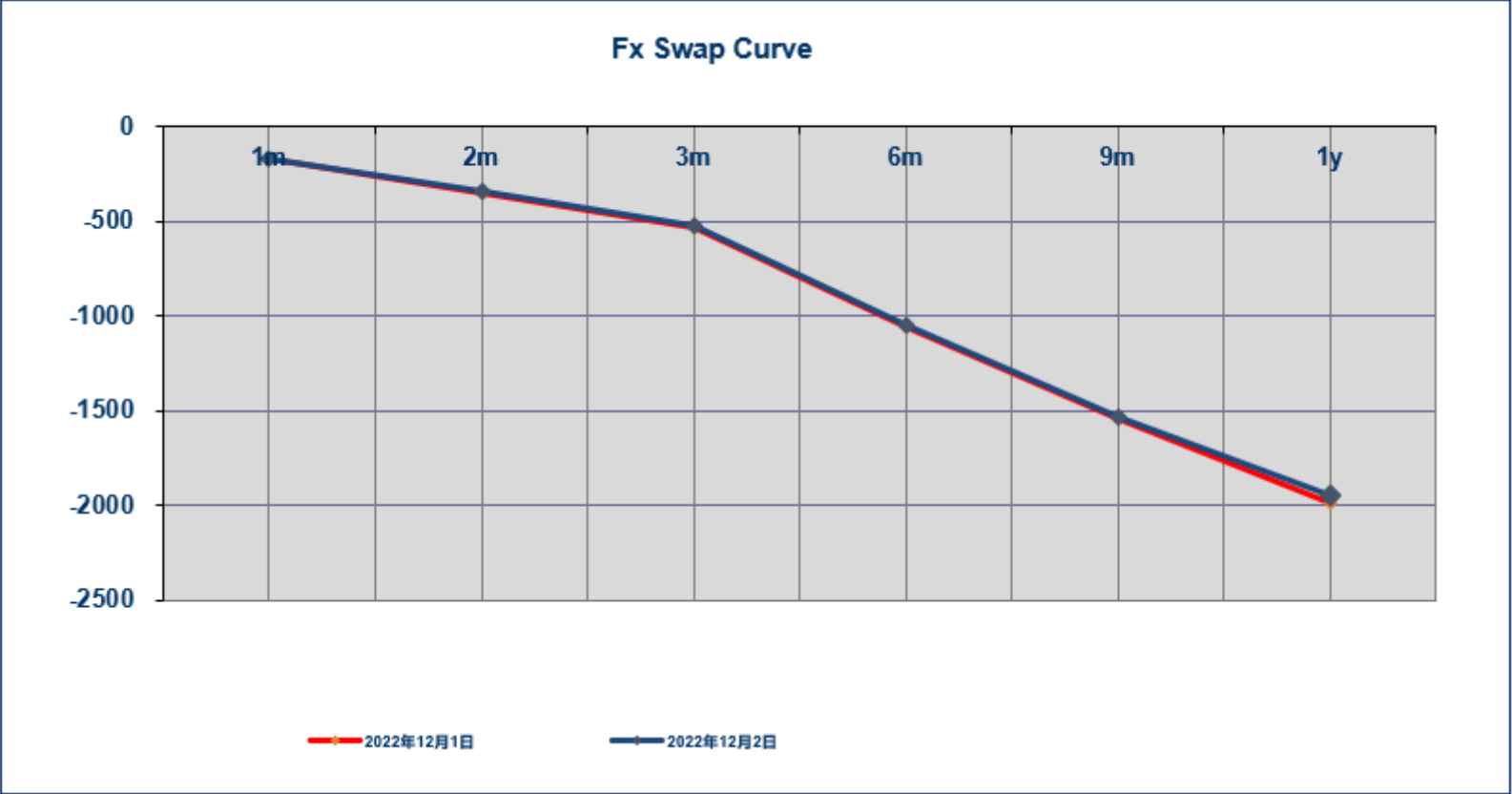
中长期，6s 成交在-1050~-1045，尾盘收在-1045。1y 成交在-1978~-1937，尾盘收在-1942。

长期限上，2y 成交在-2750。3y 成交在-3000。

Spread 上，1*2s 成交在-180，-179。2*3s 成交在-175。6*12s 成交在-890。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-38	7.0342	-0.81
2W	14	-76	7.0304	0
1M	31	-171	7.0210	-1.5
2M	62	-348	7.0032	6
3M	90	-520	6.9860	14
6M	182	-1049	6.9331	11
9M	274	-1530	6.8850	15
1Y	365	-1949	6.8431	36
18M	548	-2450	6.7930	200
2Y	731	-2750	6.7630	140
3Y	1098	-2882	6.7498	218
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0542	
CLOSING SPOT RATE			7.0380	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-177.5	-349.5	-878.5	-1359.5	-1778.5
2M		-172	-701	-1182	-1601
3M			-529	-1010	-1429
6M				-481	-900
9M					-419



文 / Jason Ge

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