

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

【2022-11-24】

今日 Fixing 定在 7.1201, 较上一交易日下降了 80 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所下降。

短端, T/N 主要成交在-18~-16.16 的位置。S/N 主要成交在-5.6~-5.45 的位置。1w 成交在-37.1~-36.75 等位置。2w 成交在-73.5, -74 的位置。1s 成交在-171, -172, -170, -169, -167.5, -166, -165 的位置。2s 成交在-362, -361, -358, -360 等位置。3s 成交在-545, -543, -542, -541, -540, -535, -533, -539, -540, -541 等位置。5s 成交在-910, -900 的位置。

中长期, 6s 成交在-1110, -1105, -1098, -1090, -1088, -1095, -1100, -1108, -1115, -1120 等位置。9s 成交在-1660, -1655, -1652, -1663, -1670 等位置。1y 成交在-2230, -2225, -2220, -2215, -2210, -2200, -2185, -2180, -2186 位置, 最后收在-2186 的位置。

Spread 方面, 1w*2w 成交在-37.5, -37 的位置。1w*1s 成交在-134 的位置。1s*2s 成交在-198, -195 的位置。2*3 成交在-179 的位置。3s*6s 成交在-560 的位置。6s*12s 成交在-1080 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-37	7.1449	-1.08
2W	14	-74	7.1412	0
1M	30	-169	7.1317	3.5
2M	63	-361	7.1125	14
3M	92	-540	7.0946	4.1
6M	183	-1125	7.0361	-38
9M	273	-1680	6.9806	-25
1Y	365	-2194	6.9292	-6
18M	547	-2900	6.8586	-25
2Y	732	-3380	6.8106	-10
3Y	1096	-3750	6.7736	-50
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1201	
CLOSING SPOT RATE			7.1486	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-192	-371	-956	-1511	-2025
2M		-179	-764	-1319	-1833
3M			-585	-1140	-1654
6M				-555	-1069
9M					-514



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:

以上所登及增加的所有信息(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