



【2022-12-09】

今日 Fixing 定在 6.9588，较上一交易日下调了 18 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日小幅上涨。

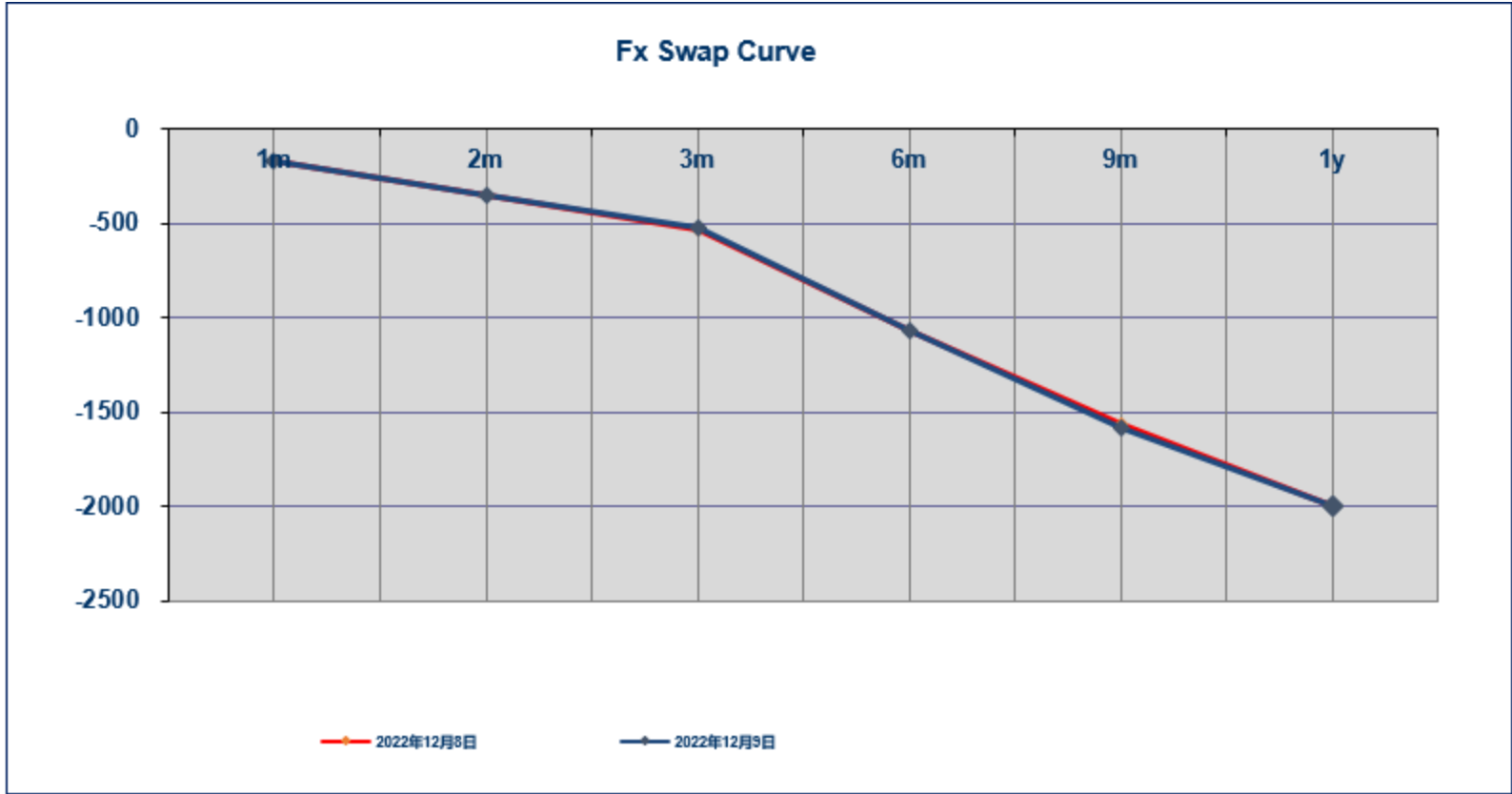
短端，O/N 成交在-16~-15.6。T/N 成交在-5.9~-5.5。S/N 成交在-5.9~-5.5。1w 成交在-41~-40.5。2w 成交-82~-81。1s 成交在-175.5~-175。2s 成交在-353.5~-352。3s 成交在-529~-527，尾盘收在-528。

中长期限，6s 成交在-1082~-1075，尾盘收在-1075。1y 成交在-2015~-2005，尾盘收在-2001。

Spread 上，2w*3w 成交在-37，-36。2w*1s 成交在-93。3w*1s 成交在-57。1*2s 成交在-176。2*3s 成交在-177。3*6s 成交在-555，-553。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	6.9439	-1.2
2W	14	-82	6.9398	4
1M	31	-176	6.9304	-1.7
2M	62	-352	6.9128	-1
3M	90	-528	6.8952	4
6M	182	-1075	6.8405	-5
9M	274	-1581	6.7899	-11
1Y	365	-2001	6.7479	-1
18M	548	-2500	6.6980	0
2Y	731	-2750	6.6730	0
3Y	1098	-2800	6.6680	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9588	
CLOSING SPOT RATE			6.9480	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-176.3	-352.3	-899.3	-1405.3	-1825.3
2M		-176	-723	-1229	-1649
3M			-547	-1053	-1473
6M				-506	-926
9M					-420



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