



【2022-12-07】

今日美元/人民币中间价报 6.9975，较上一个交易日上调 229bp，各期限收盘价较上一交易日。

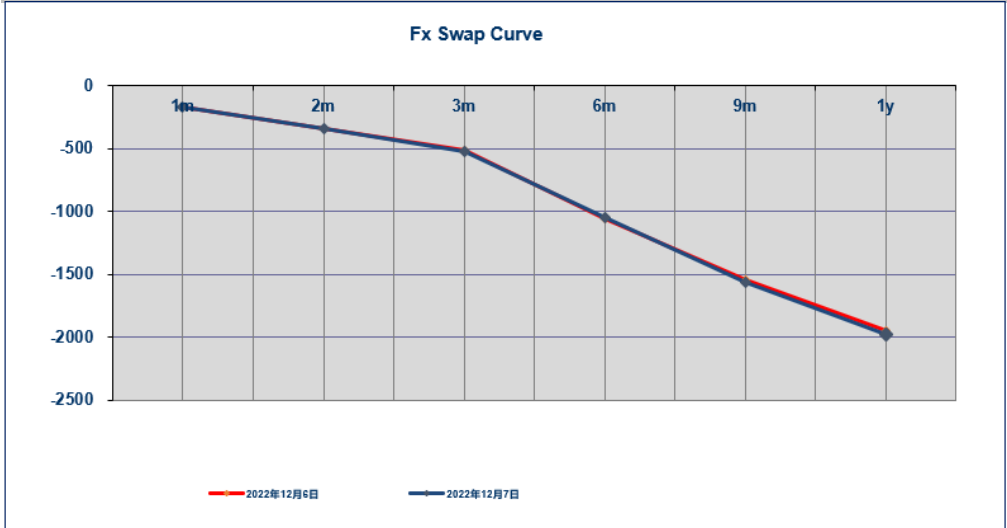
ON 成交在-5.3~-4.7 之间；TN 从-5.3 买到-5.1，后给到-5.36；SN 成交在-15.65~-15.5 之间。1W 成交在-37.6~-37.3 附近；2W 成交在-76~-75.3 之间；3W 成交在-117~-115 之间。1S 从-169 给到-171.5；2S 成交在-343~-340 之间；3S 从-508 给到-521。

中长期限，6S 成交在-1045~-1035 之间；9S 从-1515 给到-1545；1Y 从-1920 买到-1915，后一路给到-1980。

Spread 方面，1W*2W 成交在-38.7，2W*1S 成交在-95，3W*1S 成交在-55.1、-55.5，2*3S 成交在-178，3*6S 成交在-525，3*9S 成交在-1020，6*12S 成交在-910。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-38	6.9752	0
2W	14	-77	6.9714	1
1M	31	-172	6.9618	4
2M	62	-343	6.9447	-3
3M	90	-521	6.9269	-2.5
6M	182	-1055	6.8735	1
9M	276	-1565	6.8225	-25
1Y	367	-1978	6.7812	-33
18M	550	-2500	6.7290	0
2Y	731	-2750	6.7040	0
3Y	1096	-2800	6.6990	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9975	
CLOSING SPOT RATE			6.9790	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-171	-349	-883	-1393	-1806
2M		-178	-712	-1222	-1635
3M			-534	-1044	-1457
6M				-510	-923
9M					-413



文 / Cathy He

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