



【2022-12-06】

今日美元/人民币中间价报 6.9746，较上一个交易日下调 638bp，全天掉期市场交投活跃。

O/N 成交在-5.4~-5.2；T/N 成交在-5.45~-5.3；S/N 成交在-5.36~-5.34； 1w 成交在-37.6； 1s 成交在 -177~-176.5； 2s 成交在-343， -342； 3s 成交在-521~-515。

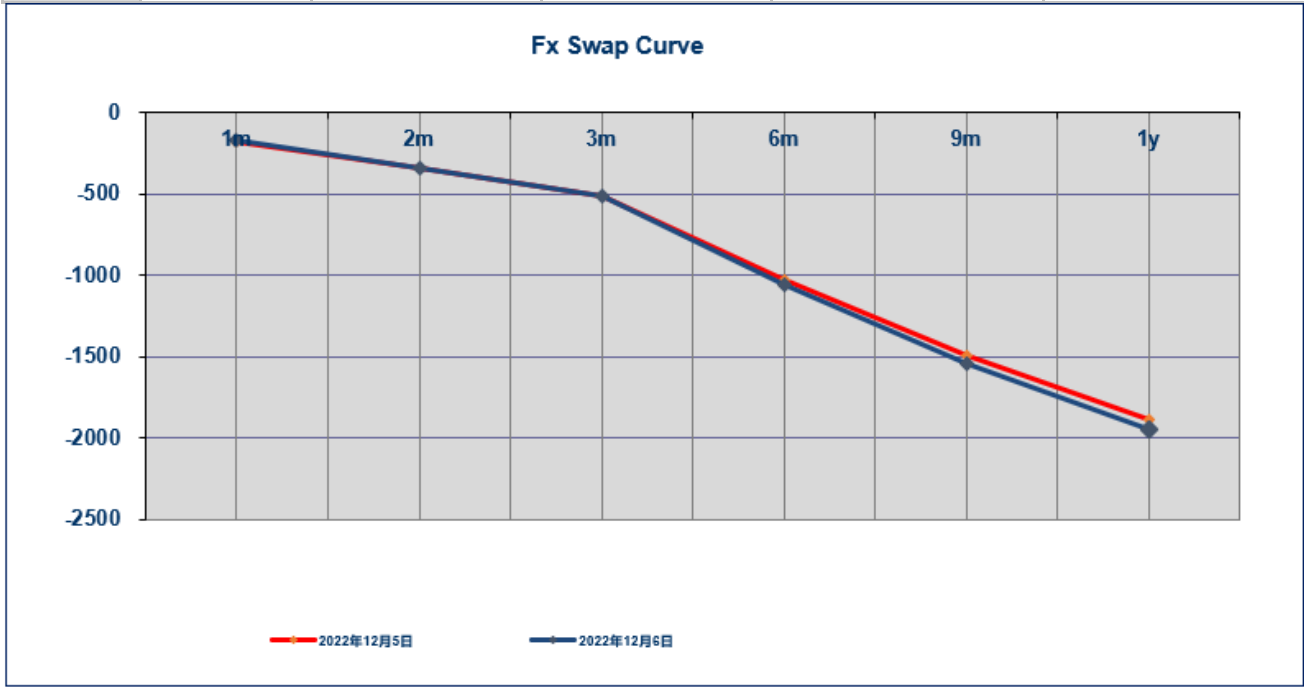
中长期限， 6s 成交在-1068~-1030； 9s 成交在-1505~1545； 1Y 成交在-1951~1900。

超长期限， 2Y 成交在-2765， -2750； 4Y 成交在-2950；

Spread 方面， 3s*9s 成交在-985。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-38	6.9971	-0.3
2W	14	-77	6.9932	-1
1M	32	-176	6.9833	1
2M	62	-340	6.9669	-1
3M	90	-519	6.9491	-7.5
6M	182	-1056	6.8953	-31
9M	274	-1540	6.8469	-45
1Y	365	-1945	6.8064	-60
18M	551	-2500	6.7509	-65
2Y	732	-2750	6.7259	-130
3Y	1096	-2800	6.7209	-260
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9746	
CLOSING SPOT RATE			7.0009	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-164	-342.5	-880	-1364	-1769
2M		-178.5	-716	-1200	-1605
3M			-537.5	-1021.5	-1426.5
6M				-484	-889
9M					-405



文 / Edison Zeng

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