

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列

**NEX** 上海国际货币经纪  
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2022-06-09】

今日 Fixing 定在 6.6811, 较上一交易日上调了 177 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日大幅下跌。

短端, O/N 成交在+1.27。T/N 成交在+3.45~+3.75。S/N 成交在+1.16~+1.22。1w 成交在+8~+8.1。1s 成交在+29.5~+31。2s 成交在+47。3s 成交在+53~+55。

中长期, 6s 成交在+32.5~+35, 反复成交在+34, +33, +32.5。9s 成交在-5。1y 成交在-50~-40, 尾盘收在-52 的位置。

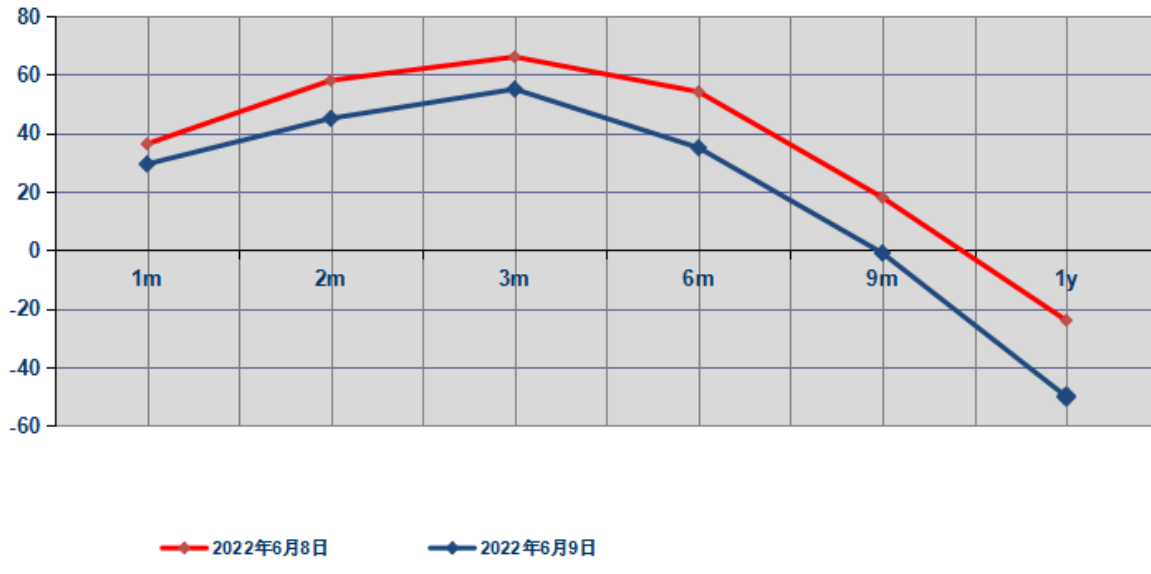
长期上, 2y 成交在-140。

Spread 上, 1\*2s 成交在+17.5。1\*3s 成交在+23.5, +24。3\*6s 成交在-20, -19。6\*9s 成交在-35。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	8	8	6.6845	-0.24
2W	14	12	6.6849	-2
1M	30	29	6.6866	-6.9
2M	63	45	6.6882	-13
3M	92	55	6.6892	-11
6M	183	35	6.6872	-19
9M	273	-1	6.6836	-19
1Y	365	-50	6.6787	-26
18M	548	-100	6.6737	0
2Y	731	-140	6.6697	-45
3Y	1096	-120	6.6717	-30
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.6811	
CLOSING SPOT RATE			6.6837	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	15.6	25.6	5.6	-30.4	-79.4
2M		10	-10	-46	-95
3M			-20	-56	-105
6M				-36	-85
9M					-49

Fx Swap Curve



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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)