

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

【2022-12-01】

今日 Fixing 定在 7.1225, 较上一交易日下降了 544 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端, O/N 主要成交在-5.5~-4.2。T/N 主要成交在-16.66~-16 的位置。S/N 主要成交在-5.5~-5.3 的位置。1w 成交在-37.1, -37, -36.8, -36.9 等位置。1s 成交在-168, -170, -173, -172, -170, -168, -169 的位置。2s 成交在-350 等位置。3s 成交在-535, -534, -532, -530, -528, -531, -533.5 等位置。

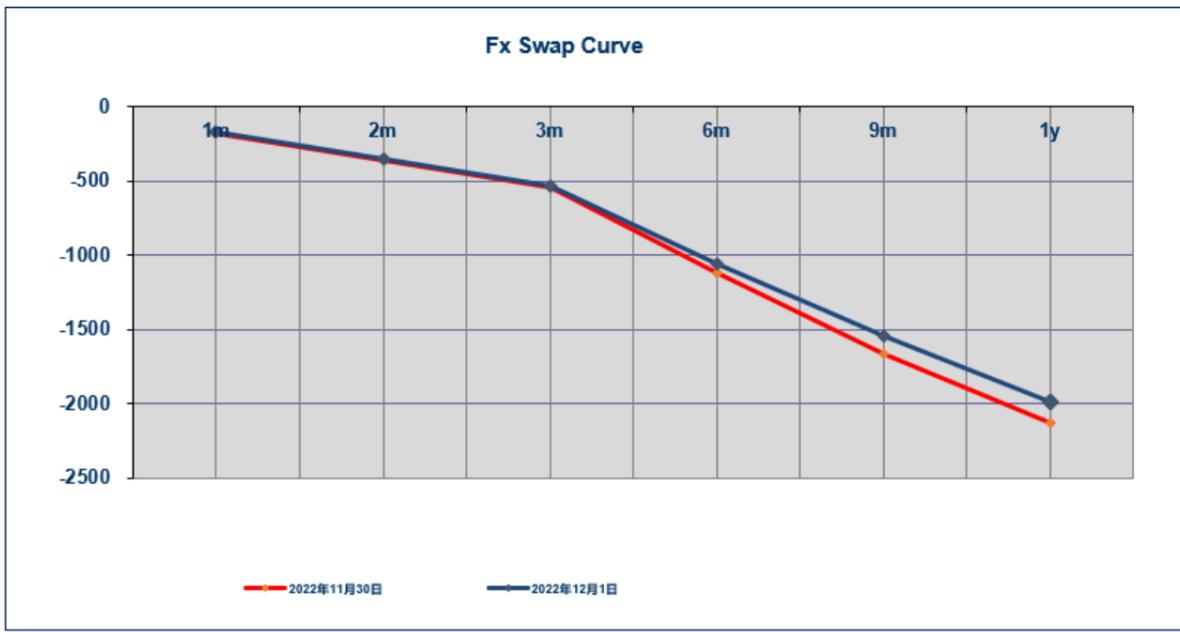
中长期, 6s 成交在-1055, -1050, -1048, -1045, -1040, -1046, -1055, -1060, -1066 等位置。9s 成交在-1550, -1530, -1527.5, -1522.5, -1526, -1550 等位置。1y 成交在-2000, -1990, -1980, -1975, -1970, -1960, -1965, -1980, -1990, -1985 位置。

超长方面, 2y 成交在-2900 的位置。

Spread 方面, 1s*3s 成交在-360 的位置。3s*6s 成交在-515 的位置。6s*9s 成交在-482.5 的位置。6s*12s 成交在-940, -935, -930 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-37	7.0754	2.25
2W	14	-76	7.0715	2
1M	31	-169	7.0622	8.5
2M	63	-354	7.0438	10
3M	91	-534	7.0257	8
6M	182	-1060	6.9731	58
9M	274	-1545	6.9246	118
1Y	365	-1985	6.8806	141
18M	548	-2650	6.8141	225
2Y	731	-2890	6.7901	350
3Y	1096	-3100	6.7691	450
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1225	
CLOSING SPOT RATE			7.0791	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-184.5	-365	-891	-1376	-1816
2M		-180.5	-706.5	-1191.5	-1631.5
3M			-526	-1011	-1451
6M				-485	-925
9M					-440



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:

以上所提及及附加的所有信息 (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