

# 收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列



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

**【2024-11-14】**

今日 Fixing 定在 7.1966，较上一交易日下降了 25 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-5.7~-5.3。T/N 主要成交在-16.65~-16.5 的位置。S/N 主要成交在-5.6~-5.56 的位置。1w 成交在-39.4，-39.35 的位置。2w 成交在-77.3 的位置。3w 成交在-115.3 的位置。1s 成交在-166，-165.8，-165.5，-165.3 等位置。2s 成交在-355，-358，-360，-358.5，-357 的位置。3s 成交在-520，-523，-525，-524.5，-522 等位置。4s 成交在-695 的位置。

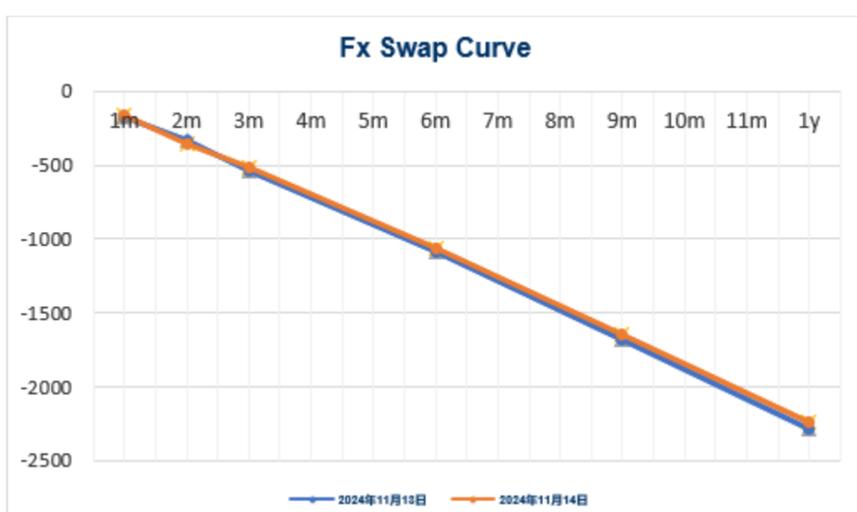
中长期，6s 成交在-1070，-1075，-1080，-1083，-1085，-1078，-1075，-1069 等位置。9s 成交在-1680，-1682，-1675，-1670，-1665，-1655，-1650 等位置。1y 成交在-2260，-2270，-2275，-2277，-2268，-2265，-2260，-2250，-2230，-2237 等位置。

超长期限，18s 成交在-3210，-3205，-3190，-3180 等位置。

Spread 方面，3w\*1s 成交在-50 的位置。2\*3s 成交在-164 的位置。9\*12s 成交在-595 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.2370	-0.83
2W	14	-77	7.2332	0
1M	30	-166	7.2243	3.01
2M	64	-358	7.2052	-20
3M	92	-522	7.1887	17.3
6M	182	-1070	7.1339	15
9M	273	-1647	7.0762	33
1Y	365	-2235	7.0174	47
18M	546	-3170	6.9239	35
2Y	730	-3950	6.8459	0
3Y	1095	-5100	6.7309	-50
<b>CNY CENTRAL PARITY RATE</b>			7.1966	
<b>CLOSING SPOT RATE</b>			7.2409	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-191.5	-356	-904	-1481	-2069
2M		-164.5	-712.5	-1289.5	-1877.5
3M			-548	-1125	-1713
6M				-577	-1165
9M					-588



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**