

# 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

**【2024-11-21】**

今日 Fixing 定在 7.1934，较上一交易日下降了 1 个 bp。各期限收盘价较上一交易日有所下降。

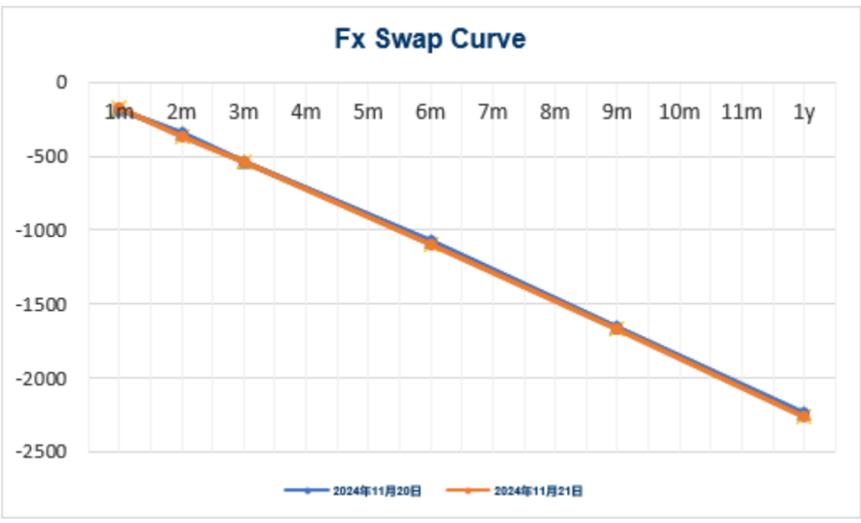
短端，O/N 主要成交在-6.3~-5.85。T/N 主要成交在-17.88~-17.5 的位置。S/N 主要成交在-5.95~-5.6 的位置。1w 成交在-41.2, -41, -40.8, -40.5 的位置。1s 成交在-181, -180.5, -180.3, -180 等位置。2s 成交在-362, -363 的位置。3s 成交在-532, -533, -532.5 等位置。

中长期，6s 成交在-1090, -1095, -1096, -1100, -1097, -1098.5 等位置。9s 成交在-1660, -1665, -1670 等位置。1y 成交在-2255, -2260, -2265, -2258, -2260 等位置。

Spread 方面，1\*2w 成交在-41 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-41	7.2369	0.59
2W	14	-81	7.2329	0
1M	31	-180	7.2230	0.9
2M	63	-363	7.2047	-13
3M	92	-534	7.1876	8
6M	183	-1098	7.1312	-18
9M	304	-1668	7.0743	-14.5
1Y	365	-2263	7.0147	-20
18M	547	-3190	6.9220	-35
2Y	730	-3980	6.8430	-50
3Y	1096	-5190	6.7220	35
<b>CNY CENTRAL PARITY RATE</b>			7.1934	
<b>CLOSING SPOT RATE</b>			7.2410	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-183.2	-354	-918	-1487.5	-2083
2M		-170.8	-734.8	-1304.3	-1899.8
3M			-564	-1133.5	-1729
6M				-569.5	-1165
9M					-595.5



文 / Yiff Wang