

# 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

**【2024-09-25】**

今日 Fixing 定在 7.0202, 较上一交易日下调了 308 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所上行。

短端, O/N 成交在 -6.55~-5 的位置; T/N 成交在 -6.7~-6.6 的位置; S/N 成交在 -19.21~-18.5 的位置。1w 成交在 -72, -70 的位置; 2w 成交在 -90.5 的位置; 2s 成交在 -384, -381.5, -378, -376 的位置; 3s 成交在 -558, -556, -553, -552, -549 的位置; 4s 成交在 -721, -718, -708, -702, -701 的位置。

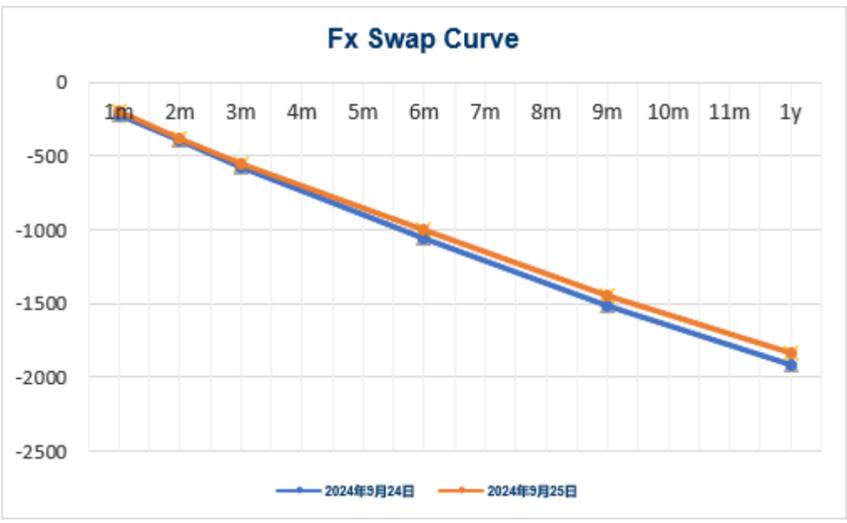
中长期, 6s 成交在 -1027, -1023, -1020, -1016, -1001, -1000 的位置; 9s 成交在 -1447, -1440 的位置; 1y 成交在 -1860, -1845, -1840, -1835 的位置。

超长期, 2y 成交在 -2730 的位置; 3y 成交在 -3450 的位置。

Spread 上, 1w\*2w 成交在 -20 的位置; 2s\*6s 成交在 -645, -643 的位置; 2s\*3s 成交在 -169 的位置; 3s\*4s 成交在 -149 的位置; 2s\*12s 成交在 -1480 的位置; 3s\*12s 成交在 -1291, -1283 的位置; 6s\*12s 成交在 -835 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	11	-70	7.0148	12.7
2W	14	-89	7.0129	8
1M	31	-197	7.0021	20
2M	61	-378	6.9840	19
3M	91	-549	6.9669	24
6M	181	-1000	6.9218	57
9M	273	-1445	6.8773	67
1Y	367	-1840	6.8378	72
18M	546	-2330	6.7888	90
2Y	731	-2730	6.7488	80
3Y	1095	-3460	6.6758	70
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0202	
CLOSING SPOT RATE			7.0218	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-181	-352	-803	-1248	-1643
2M		-171	-622	-1067	-1462
3M			-451	-896	-1291
6M				-445	-840
9M					-395



文 / Edward Sun