

# 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

**【2024-07-04】**

今日 Fixing 定在 7.1305, 较上一交易日下调了 7 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, T/N 成交在 -22.45~-20.5 的位置; S/N 成交在 -7.55~-7.46 的位置。1w 较多成交在 -53, -52.95, -52.5 的位置; 2w 成交在 -106.3 的位置; 3w 成交在 -159.5 的位置; 1s 成交在 -238.3, -238.1 的位置; 3s 成交在 -731 的位置, 成交寡淡。

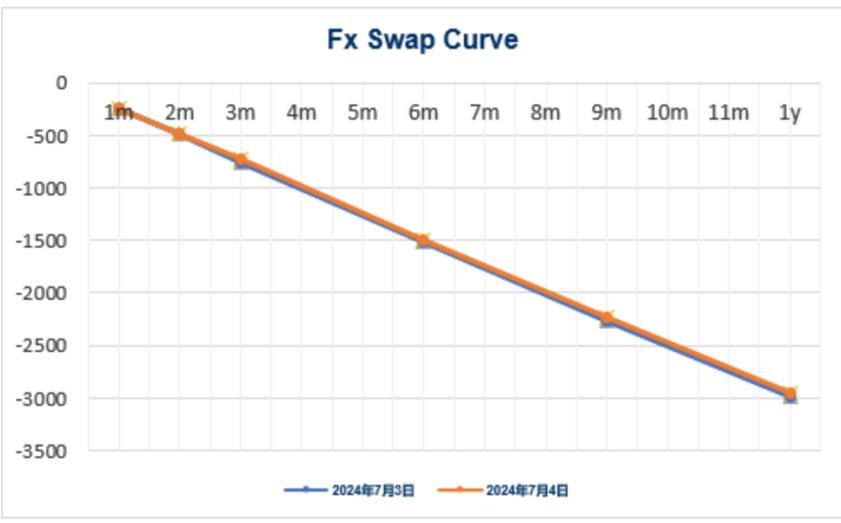
中长期限, 6s 成交主要成交 -1499 的位置; 9s 成交在 -2246, -2242, -2240 的位置; 1y 今日成交较多, 开盘在 -2970 的位置, 较多成交在 -2970, -2967, -2966 的位置, 尾盘收在 -2962 的位置。

超长期限, 18s 成交在 -4190 的位置; 3y 成交在 -6200 的位置。

Spread 上, 2w\*3w 成交在 -53.2 的位置; 3w\*1s 成交在 -78.5 的位置; 6s\*1y 成交在 -1470, -1466 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2646	0.6
2W	14	-106	7.2592	0
1M	31	-238	7.2460	0.6
2M	63	-492	7.2206	-7
3M	92	-729	7.1969	27
6M	184	-1488	7.1210	20
9M	274	-2234	7.0464	31
1Y	365	-2950	6.9748	35
18M	549	-4135	6.8563	50
2Y	730	-5030	6.7668	40
3Y	1095	-6175	6.6523	35
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1305	
CLOSING SPOT RATE			7.2698	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-254.2	-491.2	-1250.2	-1996.2	-2712.2
2M		-237	-996	-1742	-2458
3M			-759	-1505	-2221
6M				-746	-1462
9M					-716



文 / Edward Sun

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**