

# 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-NIX International Money Broking

【2024-04-18】

今日 Fixing 定在 7.1020, 较上一交易日上调了 5 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 -7~-6 的位置, T/N 成交在 -21.7~-20.65 的位置, S/N 成交在 -7.25~-7.07 的位置。1w 成交在 -50, -49.8, -49.7, -49.6 的位置; 2w 成交在 -101 的位置; 1s 成交在 -218, -217 的位置; 2s 成交在 -460.4, -459 的位置; 3s 成交在 -672, -671, -670 的位置。

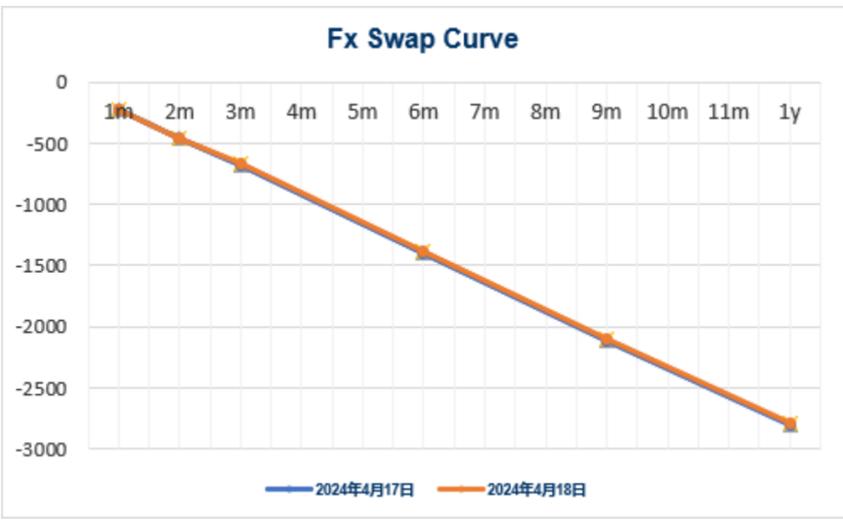
中长期, 6s 成交在 -1376, -1370, -1366, -1364 的位置; 9s 成交在 -2098, -2083, -2081 的位置; 1y 反复成交在 -2796.5, -2795, -2794, -2785, -2775, -2772 的位置。

超长期, 2y 成交在 -4740 的位置。

Spread 上, 2s\*6s 成交在 -911 的位置; 6s\*9s 成交在 -722 的位置。

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward(Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|--------------|------------|
| 1W                      | 7    | -50        | 7.2340       | 1.26       |
| 2W                      | 14   | -101       | 7.2289       | 24         |
| 1M                      | 30   | -218       | 7.2172       | 8.8        |
| 2M                      | 63   | -462       | 7.1928       | -8         |
| 3M                      | 91   | -672       | 7.1718       | 1          |
| 6M                      | 183  | -1377      | 7.1013       | 13         |
| 9M                      | 275  | -2096      | 7.0294       | 15         |
| 1Y                      | 365  | -2795      | 6.9595       | 7          |
| 18M                     | 546  | -3945      | 6.8445       | 35         |
| 2Y                      | 730  | -4813      | 6.7577       | 7          |
| 3Y                      | 1095 | -5925      | 6.6465       | 75         |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 7.1020       |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 7.2390       |            |

| USD/CNY Spread Ref. |        |        |         |         |         |
|---------------------|--------|--------|---------|---------|---------|
|                     | 2M     | 3M     | 6M      | 9M      | 1Y      |
| 1M                  | -243.8 | -453.8 | -1158.8 | -1877.8 | -2576.8 |
| 2M                  |        | -210   | -915    | -1634   | -2333   |
| 3M                  |        |        | -705    | -1424   | -2123   |
| 6M                  |        |        |         | -719    | -1418   |
| 9M                  |        |        |         |         | -699    |



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**