

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

【2024-11-08】

今日 Fixing 定在 7.1433，较上一交易日下调了 226 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日大幅上升。

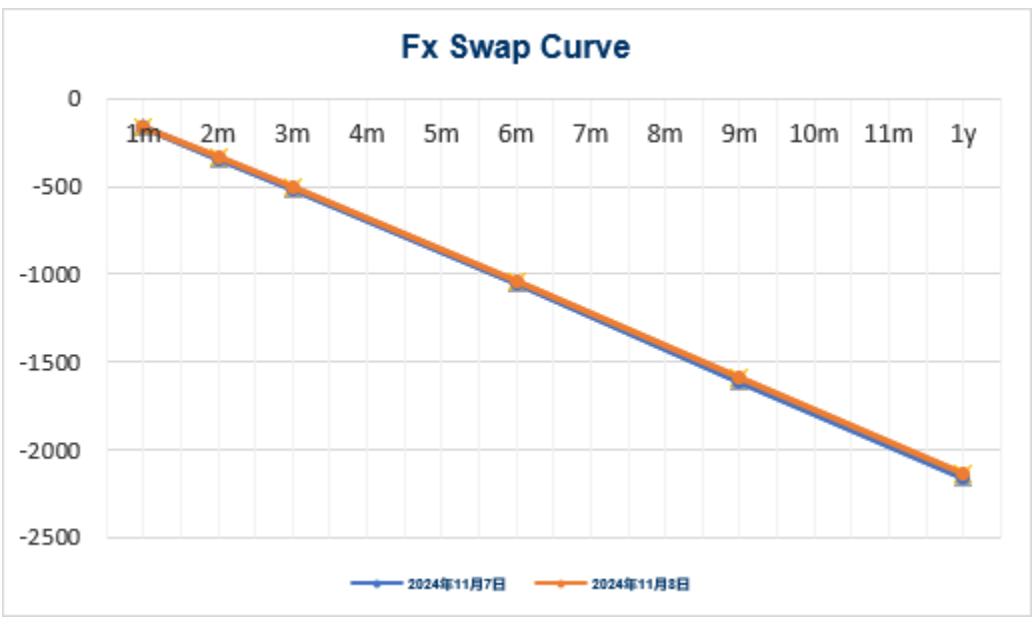
短端，O/N 成交在-22.4~-20.5。S/N 成交在-5.65~-5.55。1w 成交在-39.1~-39。2w 成交在-77。3w 成交在-116。1s 成交在-162~-161。2s 成交在-335~-333。3s 成交在-507~-505，尾盘收在-506。5s 成交在-875。

中长期限，6s 成交在-1048~-1030。9s 成交在-1595~-1575。1y 成交在-2150~-2120，尾盘收在-2120。

Spread 上，3*6s 成交在-538。6*9s 成交在 -549~-544。9*12s 成交在-551~-548。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-39	7.1609	1.52
2W	14	-78	7.1570	1
1M	30	-162	7.1486	4.1
2M	62	-335	7.1313	6
3M	92	-508	7.1140	5.1
6M	181	-1038	7.0610	17
9M	273	-1586	7.0062	29
1Y	365	-2140	6.9508	25
18M	546	-3000	6.8648	49
2Y	730	-3650	6.7998	50
3Y	1095	-4650	6.6998	75
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1433	
CLOSING SPOT RATE			7.1648	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-173.3	-345.9	-876	-1424	-1978
2M		-172.6	-702.7	-1250.7	-1804.7
3M			-530.1	-1078.1	-1632.1
6M				-548	-1102
9M					-554



文 / Jason Ge