

# 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

**【2024-11-18】**

今日美元/人民币中间价报 7.1907，较上一个交易日下调 85bp，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

ON 成交在 -5.65~-5.4；TN 成交在 -5.65~-5.53；SN 成交在 -5.7~-5.53 之间。

1w 成交在 -39.4，-39.2 的位置；2w 成交在 -77.1 的位置；1S 反复成交在 -167.2~-167 之间；2S 从 -345 买到 -344，午后又给到 -347；3S 成交在 -520，-519.5，-519，-518 附近。

中长期限，6s 成交在 -1058，-1055，-1054 午后给到过 -1065，尾盘收在 -1071；9S 成交在 -1615，-1613，午后买到过 -1608 附近，尾盘又给到 -1643 附近；1Y 从 -2165 给到 -2172 附近，午后成交在 -2175，-2176，-2180，-2185 附近，随后又给到 -2195 附近，尾盘收在 -2219。

超长期限，4Y 成交在 -5500。

Spread 方面，4s\*5s 成交在 -195；5s\*6s 成交在 -172；6s\*9s\*1y 成交在 -3,par。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-40	7.2401	-0.8
2W	14	-77	7.2364	0
1M	30	-167	7.2274	-0.4
2M	62	-347	7.2094	6
3M	92	-523	7.1918	-2
6M	181	-1071	7.1370	-6
9M	273	-1643	7.0798	-10
1Y	365	-2222	7.0219	-22
18M	546	-3120	6.9321	5
2Y	730	-3888	6.8553	-8
3Y	1097	-5025	6.7416	-10
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1907	
CLOSING SPOT RATE			7.2441	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-179.6	-355.6	-903.6	-1475.6	-2054.6
2M		-176	-724	-1296	-1875
3M			-548	-1120	-1699
6M				-572	-1151
9M					-579

Fx Swap Curve

