

# 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

**【2024-06-18】**

今日 Fixing 定在 7.1148, 较上一交易日上调了 1 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所下行。

短端, O/N 成交在 -14.6~-13 的位置; S/N 成交在 -7.88~-7.5 的位置。1w 较多成交在 -53.8, -53.6, -53.4, -53.2 的位置; 2w 成交在 -117, -116.7 的位置; 1s 成交在 -253, -250.5 的位置; 2s 成交在 -485 的位置; 3s 成交在 -737 的位置。

中长期, 6s 成交较少, 主要成交在 -1494, -1490, -1482 的位置; 9s 成交在 -2230, -2220, -2218.2 的位置; 1y 成交在 -2955, -2950, -2947, -2945, -2940, -2935 的位置。

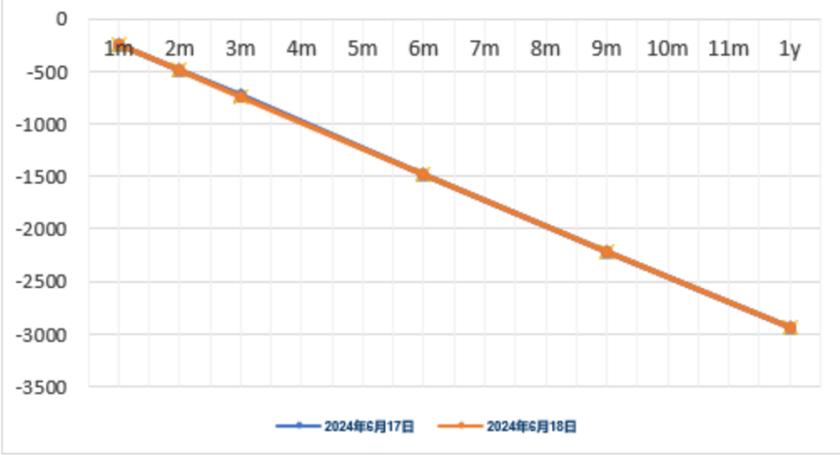
超长期, 2y 成交在 -4850 的位置; 3y 成交在 -6000 的位置。

Spread 上, 9s\*1y 成交在 -720 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-54	7.2508	-0.47
2W	15	-117	7.2445	-3
1M	32	-251	7.2312	-0.5
2M	61	-483	7.2080	-1
3M	92	-736	7.1826	-5.8
6M	183	-1482	7.1081	0
9M	273	-2216	7.0346	-1
1Y	365	-2935	6.9627	-2
18M	550	-4100	6.8462	-53
2Y	732	-4960	6.7602	-83
3Y	1096	-6000	6.6562	-45
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1148	
CLOSING SPOT RATE			7.2562	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-232	-485.5	-1231	-1965.5	-2684.5
2M		-253.5	-999	-1733.5	-2452.5
3M			-745.5	-1480	-2199
6M				-734.5	-1453.5
9M					-719

### Fx Swap Curve



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](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)