

# 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

**【2024-06-27】**

今日 Fixing 定在 7.1270，较上一交易日下调了 22 个 bp。今日，交投活跃，各期限收盘价较上一交易日有所下行。

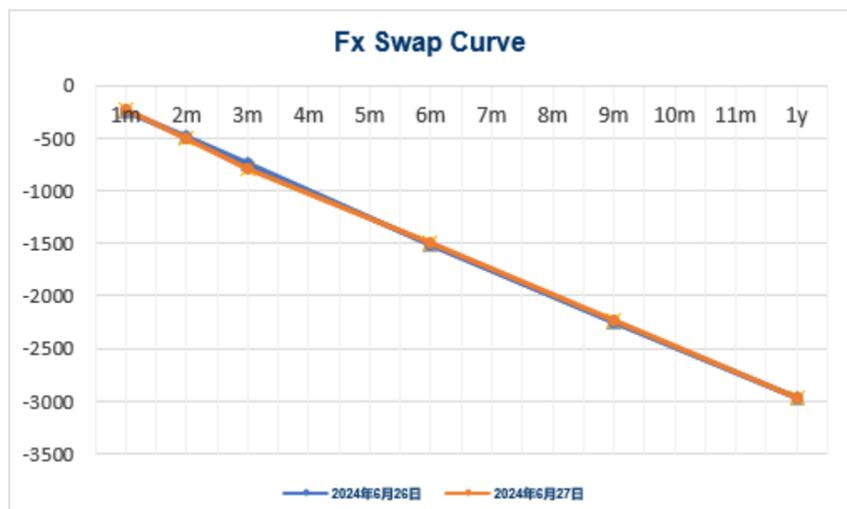
短端，O/N 成交在 -7~-6.9 的位置；T/N 成交在 -22.5~-21.4 的位置；S/N 成交在 -7.41~-7.35 的位置。1w 较多成交在 -52.15， -52.1， -52 的位置；2w 成交在 -105 的位置；1s 成交在 -236.5， -236 的位置；2s 成交在 -498 的位置；3s 成交在 -785 的位置。

中长期，6s 成交主要成交 -1505， -1503， -1500 的位置；9s 成交在 -2245， -2240 的位置；1y 成交在 -2970， -2965， -2963， -2959 的位置。

Spread 上，2w\*1s 成交在 -131 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-52	7.2637	0.25
2W	14	-105	7.2584	1
1M	31	-236	7.2454	15.2
2M	64	-498	7.2191	-8
3M	99	-785	7.1904	-42.5
6M	185	-1500	7.1189	6
9M	274	-2237	7.0452	13
1Y	365	-2963	6.9726	8
18M	553	-4150	6.8539	-40
2Y	730	-4990	6.7699	45
3Y	1095	-6060	6.6629	25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1270	
CLOSING SPOT RATE			7.2689	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-262.81	-549.5	-1264.5	-2001.5	-2727.5
2M		-286.69	-1001.69	-1738.69	-2464.69
3M			-715	-1452	-2178
6M				-737	-1463
9M					-726



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**