

# 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

**【2024-07-16】**

今日 Fixing 定在 7.1328, 较上一交易日上调了 15 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 -7.9~-7.6 的位置; T/N 成交在 -8.05~-7.73 的位置; S/N 成交在 -8.04~-7.77 的位置。1w 较多成交在 -54.5, -54, -53.8 的位置; 2w 成交在 -107.5 的位置; 3w 成交在 -161.7 的位置; 1s 成交在 -250 的位置; 3s 成交在 -730 的位置, 成交寡淡。

中长期, 6s 成交主要成交 -1502, -1500, -1498 的位置; 9s 成交在 -2210 的位置; 1y 今日成交较多, 开盘在 -2909 的位置, 随后一路走低, 较多成交在 -2916, -2909 的位置, 尾盘收在 -2914 的位置。

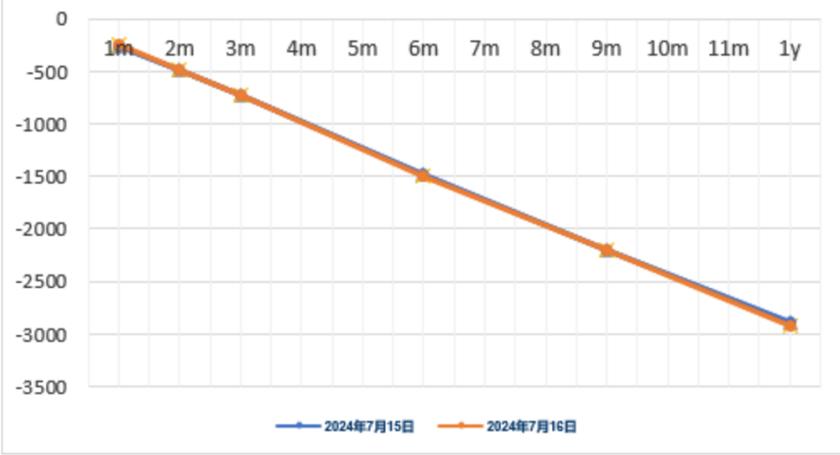
超长期, 18s 成交在 -4075 的位置; 3y 成交在 -6005, -6000, -5995 的位置。

Spread 上, 1w\*2w 成交在 -53.7 的位置; 3s\*6s 成交在 -771.5, -770 的位置; 6s\*1y 成交在 -1410 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-54	7.2608	-0.59
2W	14	-107	7.2555	0
1M	32	-249	7.2413	5.7
2M	62	-489	7.2173	5
3M	92	-730	7.1932	-1.5
6M	187	-1503	7.1159	-30
9M	274	-2208	7.0454	-8
1Y	365	-2915	6.9747	-18
18M	551	-4070	6.8592	-10
2Y	732	-4921	6.7741	-11
3Y	1096	-5997	6.6665	58
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1328	
CLOSING SPOT RATE			7.2662	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-239.8	-481.4	-1254.2	-1959.2	-2666.2
2M		-241.6	-1014.4	-1719.4	-2426.4
3M			-772.8	-1477.8	-2184.8
6M				-705	-1412
9M					-707

### 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)