

# 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

**【2024-07-11】**

今日 Fixing 定在 7.1339, 较上一交易日上调了 3 个 bp。今日, 交投活跃, 各期限收盘价较上一交易日有所上行。

短端, O/N 成交在 -7.4~-7.2 的位置; T/N 成交在 -22.55~-22.48 的位置; S/N 成交在 -7.57~-7.53 的位置。1w 较多成交在 -52.8, -52.7 的位置; 2w 成交在 -106 的位置; 1s 成交在 -237.5, -237 的位置; 2s 成交在 -508.4 的位置; 3s 成交在 -726.7, -726.4, -725 的位置, 成交寡淡。

中长期, 6s 成交主要成交 -1482, -1481, -1480 的位置; 9s 成交在 -2222, -2219 的位置; 1y 今日成交较多, 开盘在 -2931 的位置, 随后一路走低, 较多成交在 -2938 的位置, 尾盘收在 -2925 的位置。

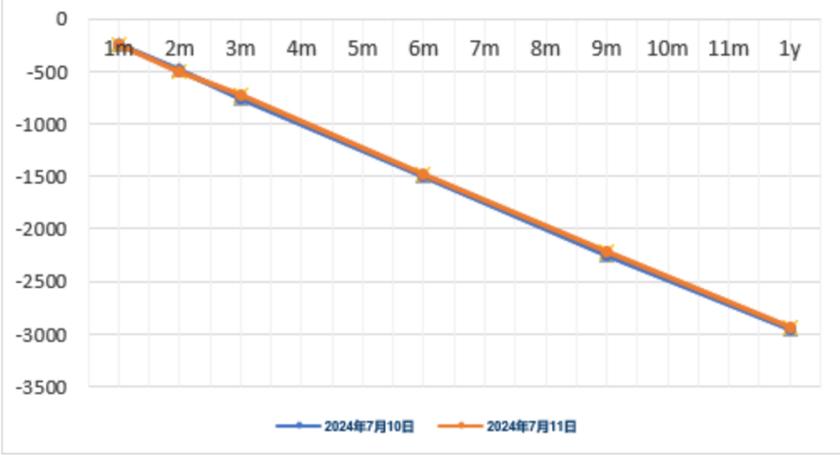
超长期, 18s 成交在 -4110, -4090 的位置。

Spread 上, 3w\*1s 成交在 -78.5 的位置; 1s\*2s 成交在 -271 的位置; 9s\*1y 成交在 -714, -712 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-53	7.2657	0.09
2W	14	-106	7.2604	0
1M	31	-238	7.2472	-0.6
2M	65	-508	7.2202	-25
3M	92	-726	7.1984	24.8
6M	184	-1480	7.1230	12
9M	274	-2218	7.0492	25
1Y	365	-2931	6.9779	27
18M	549	-4105	6.8605	30
2Y	730	-4960	6.7750	35
3Y	1095	-5998	6.6712	52
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1339	
CLOSING SPOT RATE			7.2710	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-270.5	-488.3	-1242.1	-1980.1	-2693.1
2M		-217.8	-971.6	-1709.6	-2422.6
3M			-753.8	-1491.8	-2204.8
6M				-738	-1451
9M					-713

### 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**