

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

【2021-04-21】

今日美元/人民币中间价报 6.5046，较上一个交易日下调 57bp，全天掉期市场交投活跃。

ON 成交在+3.6~+3.65 之间；TN 从+3.75 给到+3.6；SN 从+11.5 给到+11.05。1W 成交在+27.1~+27.5 之间；2W 成交在+66~+67 之间。1S 在+132~+137 之间反复成交；2S 成交在+266~+268 之间；3S 从+409 给到+400。

中长期限，6S 成交在+820~+833 之间；9S 成交在+1225~+1235 之间；1Y 早盘从+1634 给到+1630，又一路买到+1642，午后从+1635 一路给到+1615，尾盘收在+1615。

超长期限，3Y 成交在+4550、+4540。

Spread 方面，1W*2W 成交在+39.5，2W*2S 成交在+200、+200.5，2W*3S 成交在+340，1*2S 成交在+131、+132，1*3S 成交在+273，3*12S 成交在+1213，6*9S 成交在+410，9*12S 成交在+405、+408。Fly 方面，6*9*12S 成交在+5。

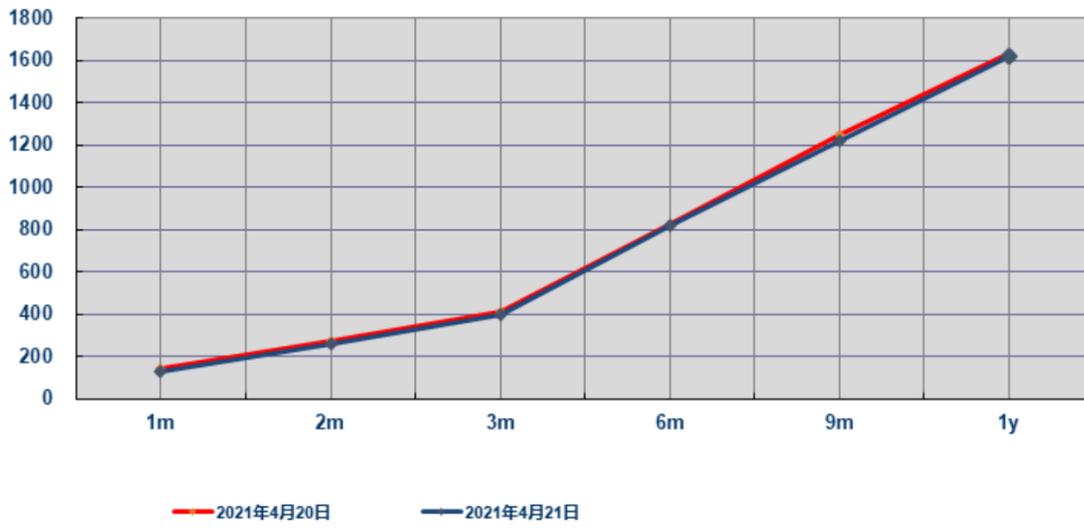
CFETS-NEX INT'L MONEY BROKING CO. LTD. FX SWAP

| Tenor | Days | Swap (Mid) | Forward (Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|---------------|------------|
| 1W | 7 | 27 | 6.4978 | -1.3 |
| 2W | 14 | 65 | 6.5016 | -2 |
| 1M | 31 | 131 | 6.5082 | -11 |
| 2M | 61 | 262 | 6.5213 | -10 |
| 3M | 91 | 400 | 6.5351 | -11 |
| 6M | 185 | 820 | 6.5771 | -3 |
| 9M | 276 | 1218 | 6.6169 | -27 |
| 1Y | 367 | 1617 | 6.6568 | -18 |
| 18M | 549 | 2460 | 6.7411 | 0 |
| 2Y | 731 | 3150 | 6.8101 | 0 |
| 3Y | 1096 | 4540 | 6.9491 | -20 |
| CNY CENTRAL PARITY RATE | | | 6.5046 | |
| CLOSING SPOT RATE | | | 6.4951 | |

USD/CNY Spread Ref.

| | 2M | 3M | 6M | 9M | 1Y |
|----|-----|-----|-----|------|------|
| 1M | 131 | 269 | 689 | 1087 | 1486 |
| 2M | | 138 | 558 | 956 | 1355 |
| 3M | | | 420 | 818 | 1217 |
| 6M | | | | 398 | 797 |
| 9M | | | | | 399 |

Fx Swap Curve



文 / Cathy He

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:

以上所提及及附加的所有信息 (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