

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，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，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。

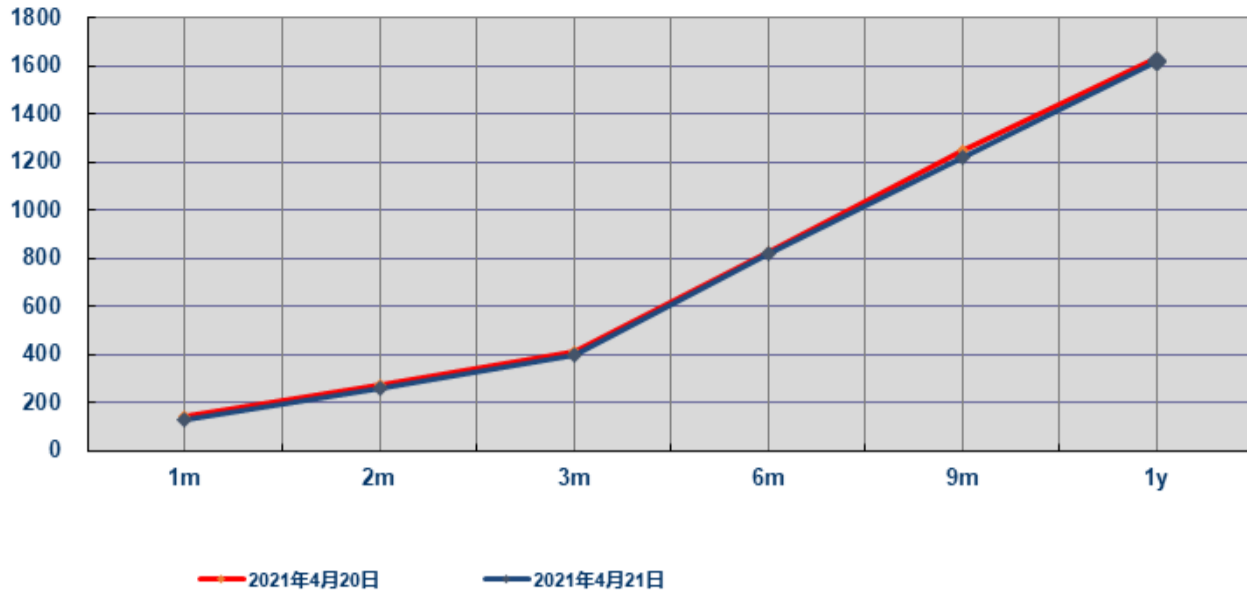
CFETS-NEX INT'L MONEY BROKING CO. LTD. FX SWAP

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