

# 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

【2021-05-14】

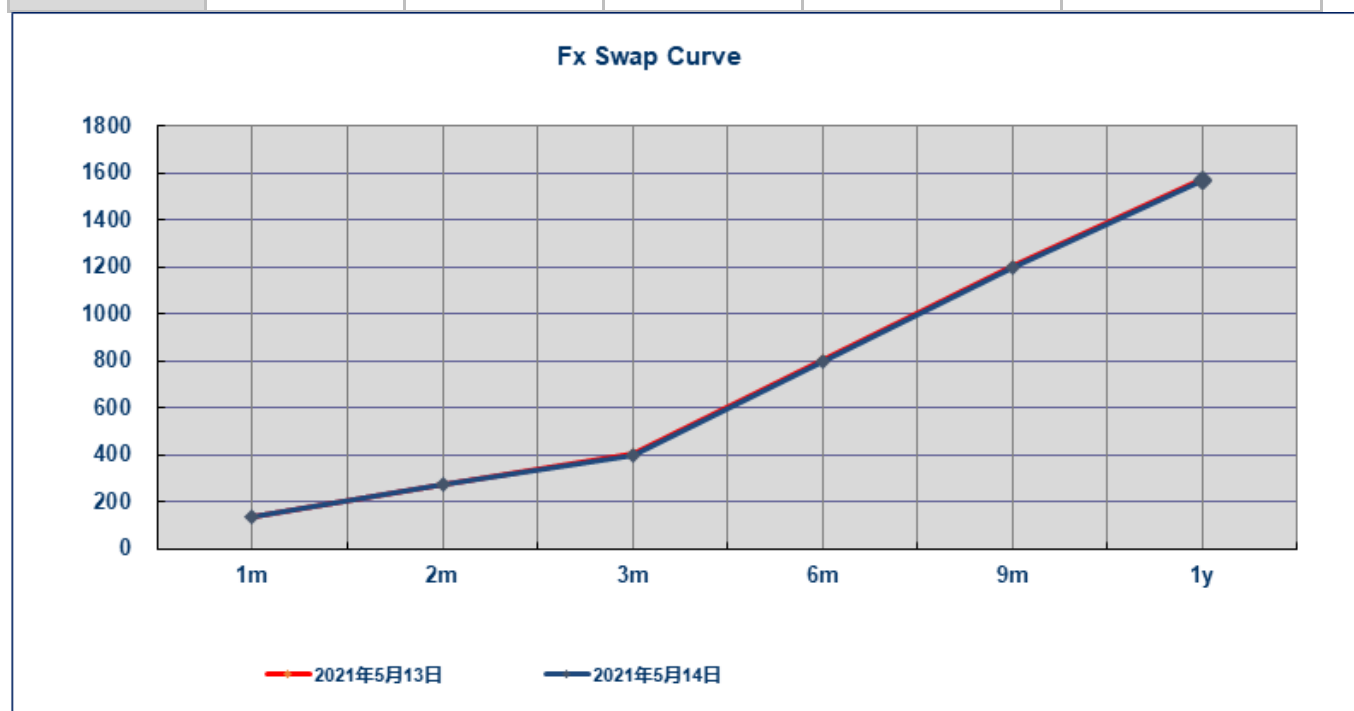
今日美元兑人民币中间价报6.4525，比上个交易日下调87个点。掉期市场成交活跃，整体价格较前一个交易日下跌。

o/n 成交+11.36、+11.35 和+11.25；t/n 依次成交在+3.93、+3.85、+3.82、+3.78、+3.83 和+3.79；s/n 成交+3.85、+3.9 和+3.89；1w 成交+27.4；1s 价格成交+132、+132.5、+131 和+133；2s 成交+268 和+271；3s 成交在+398、+399 和+397；6s 成交在+799、+798、+796 和+797；9s 成交+1200；1y 依次成交在+1570、+1567、+1564、+1566 和+1571。

Spread 方面，1w\*2w 成交+32；1s\*2s 成交+135、+137 和+136；2s\*3s 成交+130；3s\*9s 成交+801；6s\*1y 成交+770。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	28	6.4375	0.01
2W	14	60	6.4407	-4
1M	31	133	6.4480	-0.5
2M	62	271	6.4618	-4
3M	92	399	6.4746	-3
6M	184	799	6.5146	-3
9M	276	1195	6.5542	-9
1Y	365	1571	6.5918	-5
18M	549	2340	6.6687	-10
2Y	730	3040	6.7387	-10
3Y	1098	4320	6.8667	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.4525	
CLOSING SPOT RATE			6.4347	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	138	266	666	1062	1438
2M		128	528	924	1300
3M			400	796	1172
6M				396	772
9M					376



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)**