

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

【2021-04-22】

今日美元/人民币中间价报 6.4902，较上一个交易日下调 144bp，全天掉期市场交投活跃。

ON 成交在+3.65~+3.7 之间；TN 从+11 一路买到+11.51，后又给到+11.43，尾盘收回+11.5；SN 成交在+3.78~+3.96 之间，尾盘收在+3.96。1W 成交在 45~+48 之间；2W 成交在+62~+64 之间。1S 在+129.5~+132.5 之间，尾盘收在+129.5；2S 从+275 一路给到+270；3S 成交在+404~+410 之间。

中长期，6S 成交在+817~+818 之间；9S 成交在+1222~+1233 之间；1Y 成交在+1624~+1629 之间。

超长期，2Y 成交在+3150。

Spread 方面，1W*1S 成交在+85，1W*3S 成交在+360.5，1*2S 成交在+144，1*3S 成交在+275、+274，3*6S 成交在+410、+411；6*12S 成交在+811。

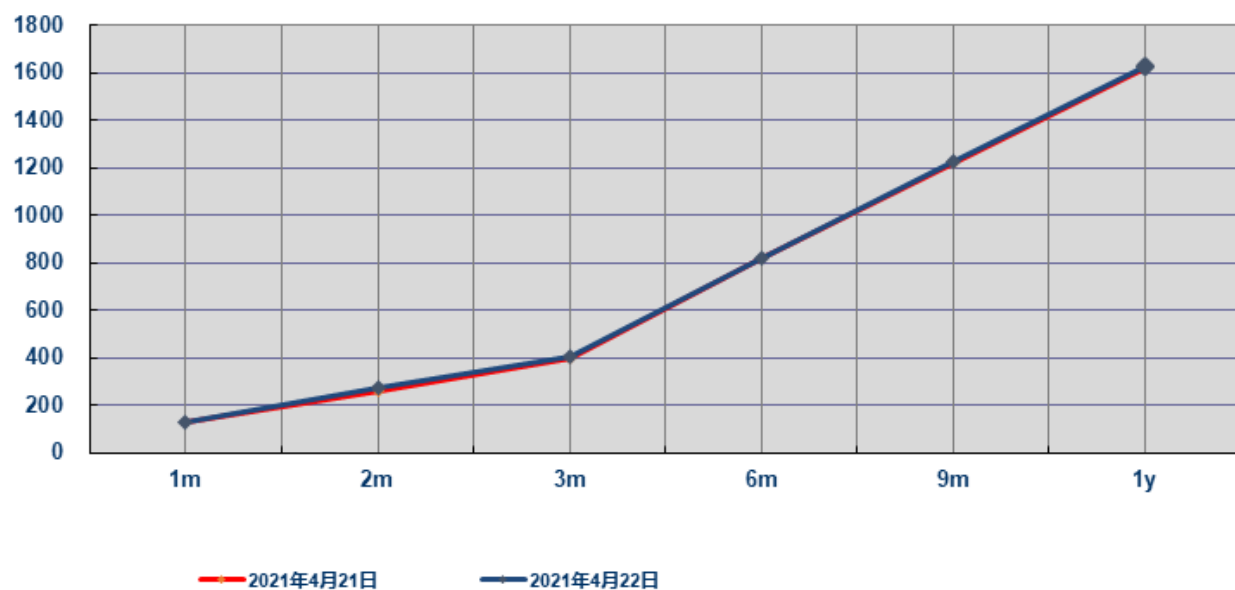
CFETS-NEX INT'L MONEY BROKING CO. LTD. FX SWAP

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward (Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	10	46	6.4934	19
2W	14	62	6.4950	-3
1M	30	131	6.5019	0
2M	63	272	6.5160	10
3M	91	404	6.5292	4
6M	183	815	6.5703	-5
9M	275	1227	6.6115	9
1Y	365	1625	6.6513	8
18M	548	2460	6.7348	0
2Y	730	3150	6.8038	0
3Y	1096	4540	6.9428	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.4902	
CLOSING SPOT RATE			6.4888	

USD/CNY Spread Ref.

	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	141	273	684	1096	1494
2M		132	543	955	1353
3M			411	823	1221
6M				412	810
9M					398

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:

以上所念及附加的所有信息 (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