

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2020-11-27】

今日美元/人民币中间价 6.5755，较上个交易日下调 25 个点。掉期产品交投活跃，价格较上一交易日下跌。

O/N 成交在+5.5; T/N 价格走高成交在+4.6、+4.8 和+5，而后下跌成交在+4.8、+4.6、+4.7、+4.3 和+4; S/N 价格成交在+3.5 和+3.4。1w 成交+27; 2w 成交+57 和+55.5。1s 市场走低成交+185、+183、+181 和+180; 2s 价格走高成交在+323、+325 和+326; 3s 价格走高成交在+503 和+508; 5s 成交在+800; 6s 价格走低成交在+938、+923、+919 和+917。1y 价格走低依次成交+1750、+1743、+1741、+1740 和+1730。

Spread 方面，1s\*2s 成交+144; 2s\*3s 成交+175。

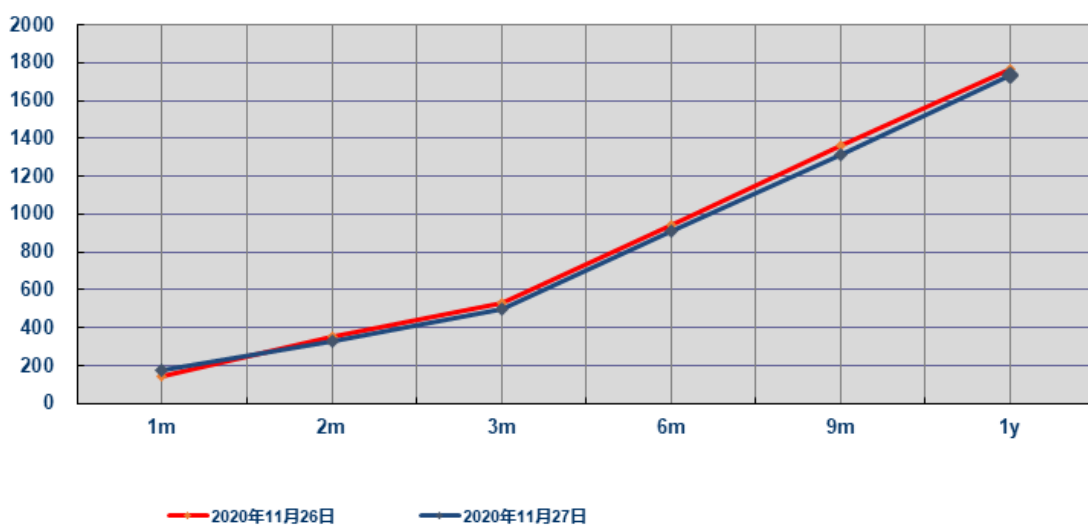
## CFETS-NEX INT'L MONEY BROKING CO. LTD. FX SWAP

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward (Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	26	6.5849	-3
2W	14	57	6.5880	-4.0
1M	34	178	6.6001	35
2M	62	325	6.6148	-29
3M	90	496	6.6319	-31
6M	182	910	6.6733	-32
9M	274	1315	6.7138	-45
1Y	365	1731	6.7554	-37
18M	547	2580	6.8403	-20
2Y	730	3480	6.9303	-25
3Y	1095	5290	7.1113	-20
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.5755	
CLOSING SPOT RATE			6.5823	

## USD/CNY Spread Ref.

	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	147	318	732	1137	1553
2M		171	585	990	1406
3M			414	819	1235
6M				405	821
9M					416

## Fx Swap Curve



文 / Weijia Ju

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