

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



【2021-01-22】

今日美元/人民币中间价报 6.4617, 较上一个交易日下调 79bp, 全天掉期市场交投活跃。

ON 从+15.2 一路买到过+15.3、+15.4、+15.5; TN 早盘在+4.8~+5.1 之间反复成交, 下午成交在+5 ~+5.3 之间; SN 早盘在+4.65~+4.8 之间反复成交, 下午从+4.8 买到+4.9。1W 从+34.5 买到+36; 2w 成交在+65~+67。1S 成交在+147~+148; 2S 成交在+255、+257; 3S 成交在+368.5~+373 之间。

中长期限, 6S 从+700 买到+707, 尾盘给过一口+705; 9S 成交在+1030; 1Y 从+1340 买到+1355, 又一路给到+1350, 尾盘收在+1350。

Spread 方面, 3W\*1S 成交在+30, 4\*6S 成交在+225, 6\*9S 成交在+325, 9\*12s 成交在+325。

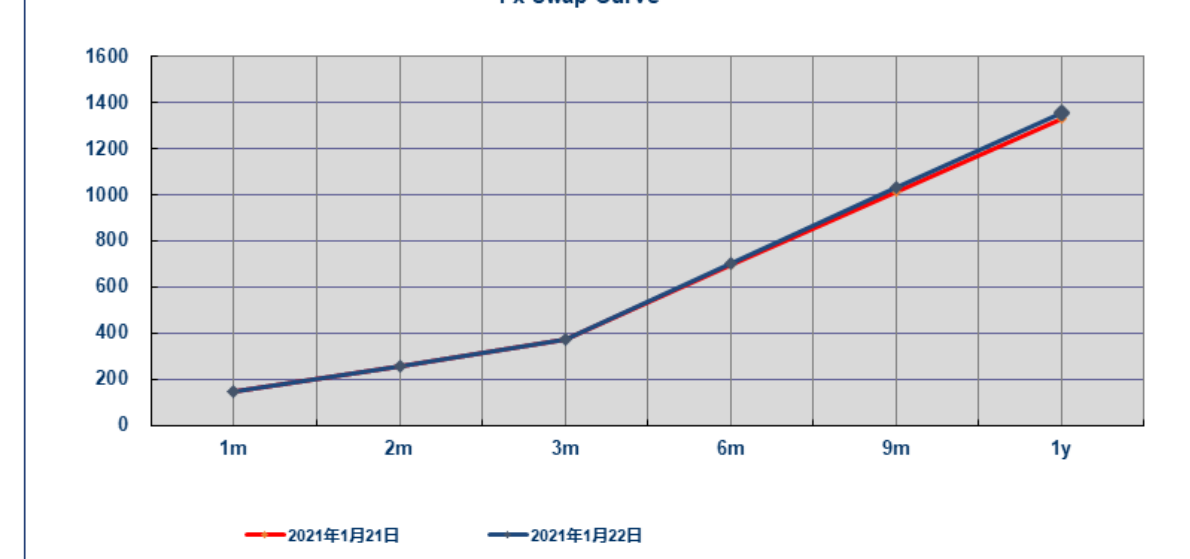
## CFETS-NEX INT'L MONEY BROKING CO. LTD. FX SWAP

| Tenor                   | Days | Swap (Mid) | Forward (Mid) | ΔSWAP PIPS |
|-------------------------|------|------------|---------------|------------|
| 1W                      | 7    | 36         | 6.4813        | 1          |
| 2W                      | 14   | 67         | 6.4844        | 0          |
| 1M                      | 31   | 148        | 6.4925        | 3          |
| 2M                      | 59   | 257        | 6.5034        | 4          |
| 3M                      | 90   | 374        | 6.5151        | 4          |
| 6M                      | 181  | 705        | 6.5482        | 10         |
| 9M                      | 273  | 1030       | 6.5807        | 15         |
| 1Y                      | 365  | 1354       | 6.6131        | 24         |
| 18M                     | 546  | 2000       | 6.6777        | 20         |
| 2Y                      | 734  | 2760       | 6.7537        | 10         |
| 3Y                      | 1095 | 4050       | 6.8827        | 20         |
| CNY CENTRAL PARITY RATE |      |            | 6.4617        |            |
| CLOSING SPOT RATE       |      |            | 6.4777        |            |

## USD/CNY Spread Ref.

|    | 2M  | 3M  | 6M  | 9M  | 1Y   |
|----|-----|-----|-----|-----|------|
| 1M | 109 | 226 | 557 | 882 | 1206 |
| 2M |     | 117 | 448 | 773 | 1097 |
| 3M |     |     | 331 | 656 | 980  |
| 6M |     |     |     | 325 | 649  |
| 9M |     |     |     |     | 324  |

## 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)**