

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

【2021-04-23】

今日美元/人民币中间价报 6.4934, 较上一个交易日上调 32bp, 全天掉期市场交投较活跃。

ON 成交在+11~+11.8 之间; TN 在+3.66~+3.8 之间反复成交; SN 从+3.7 买到+3.75。1W 在+42~+43 之间反复成交; 2W 成交在+61.5~+62.5 之间。1S 成交在+131~+134 之间; 2S 成交在+272~+274.5 之间; 3S 成交在+408~+409 之间。

中长期, 6S 从+815 一路买到+822; 9S 成交在+1230~+1240 之间; 1Y 从+1615 一路买到+1640, 尾盘收在+1640。

超长期限, 3Y 成交在+4510。

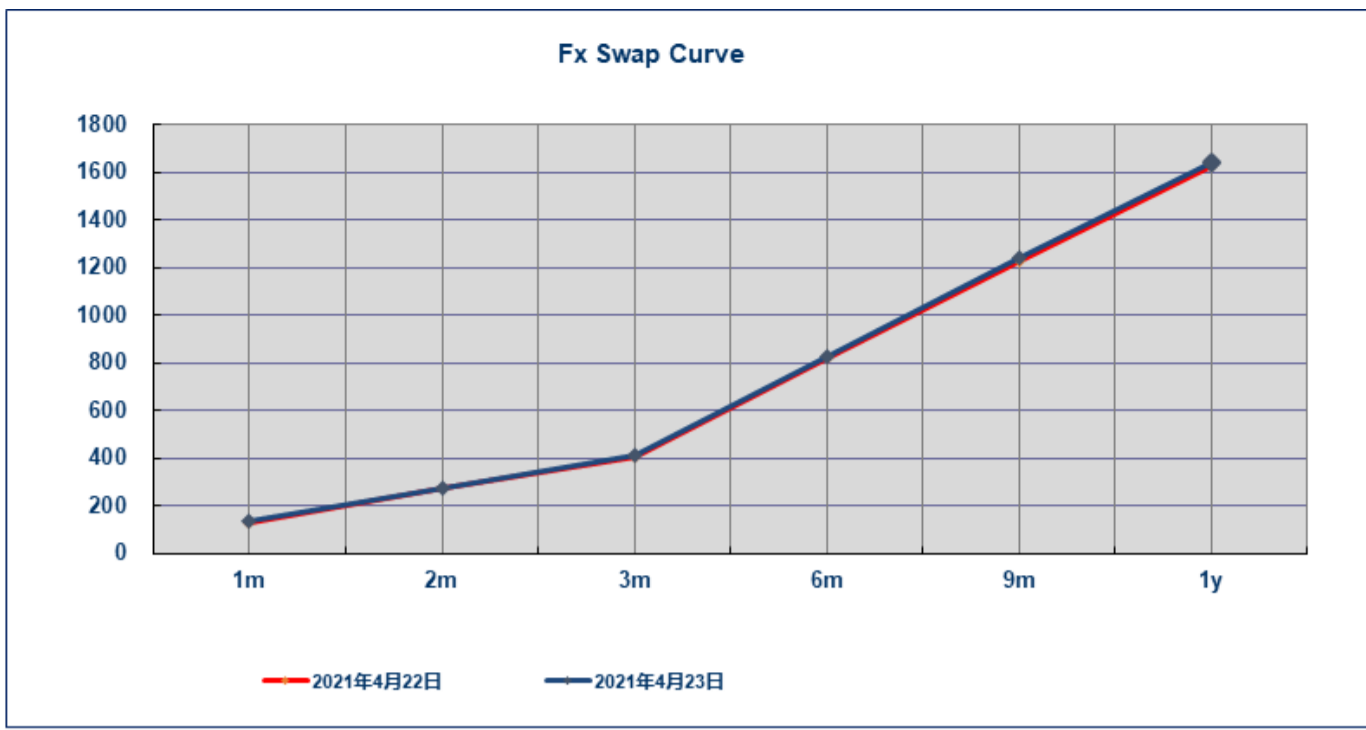
Spread 方面, 1W*2W 成交在+19.5, 2*3S 成交在+134、+135, 6*12S 成交在+812。

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

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward (Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	9	44	6.4980	-2
2W	14	63	6.4999	1
1M	30	134	6.5070	2.5
2M	62	276	6.5212	4
3M	91	409	6.5345	5
6M	183	826	6.5762	11
9M	275	1240	6.6176	13
1Y	365	1640	6.6576	15
18M	548	2450	6.7386	-10
2Y	730	3150	6.8086	0
3Y	1098	4510	6.9446	-30
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.4934	
CLOSING SPOT RATE			6.4936	

USD/CNY Spread Ref.

	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	142	275.5	692.5	1106.5	1506.5
2M		133.5	550.5	964.5	1364.5
3M			417	831	1231
6M				414	814
9M					400



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