



【2021-02-25】

今日美元兑人民币中间价报6.4522，比上个交易日下调93个点。掉期市场成交活跃，整体价格较昨日上调。

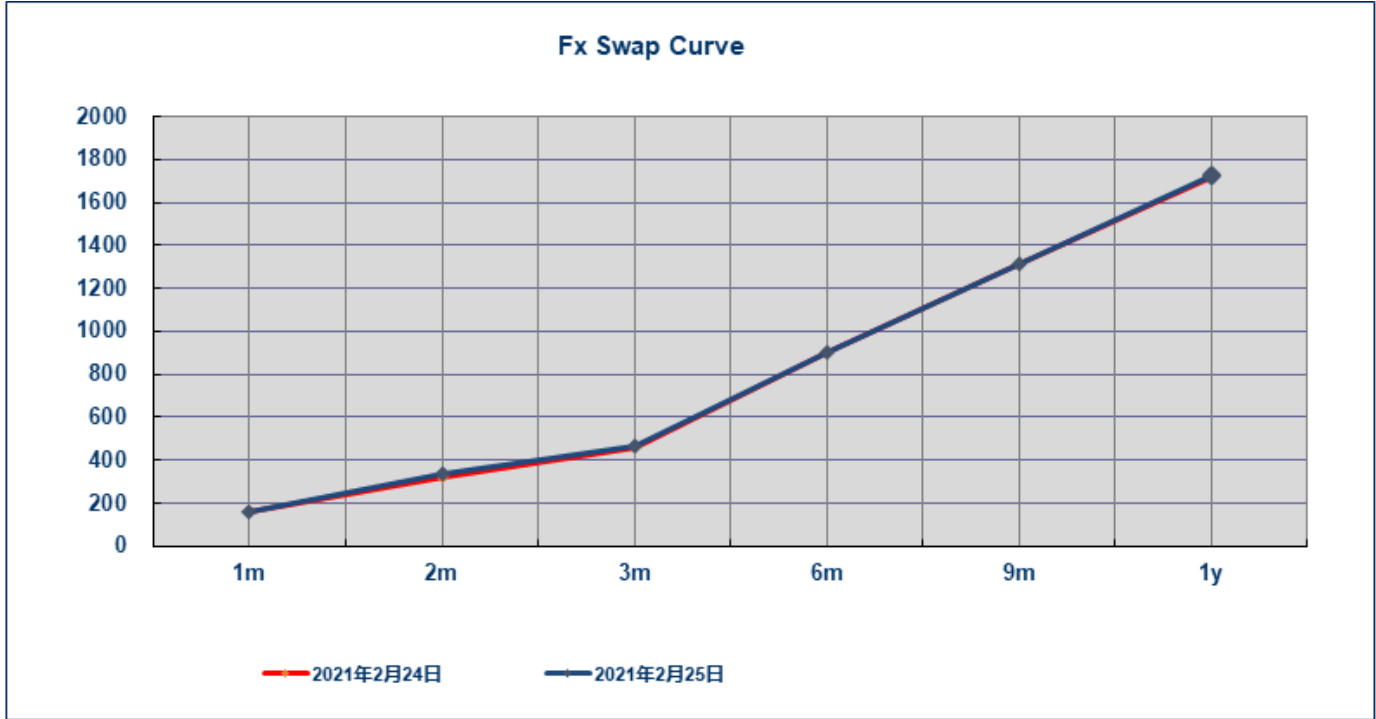
o/n 成交+3.5、+3.57、+4、+4.5、+4.6和+3.8；t/n 价格成交+16.8、+17.4、+17.5、+16.6、+16、+16.5、+16.7、+16.6、+16.55、+16.85、+17和+17.35；s/n 成交+4.4、+4.41和+4.5；1w 成交 +32.5、+33.5和+33.4；2w 成交+67；1s 高成交+160、+159和+158；2s 成交+340和+338；3s 走低成交+470、+465和+464；4s 成交+645；6s 成交+900、+901.5、+902和+901；9s 成交+1318和+1314；1y 价格依次成交+1725、+1735、+1720和+1729。

Spread方面, 1w*2w成交+33.5；1s*2s成交+180；2s*3s成交+127；9s*1y成交+413和+415。

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

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward (Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	33	6.4533	-4.1
2W	14	67	6.4567	-4
1M	31	158	6.4658	-2
2M	66	338	6.4838	20
3M	92	462	6.4962	4
6M	184	898	6.5398	-5
9M	275	1316	6.5816	4
1Y	365	1729	6.6229	8
18M	549	2570	6.7070	20
2Y	730	3400	6.7900	0
3Y	1096	4720	6.9220	20
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.4522	
CLOSING SPOT RATE			6.4500	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	180	304	740	1158	1571
2M		124	560	978	1391
3M			436	854	1267
6M				418	831
9M					413



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