

外汇市场每日简评 2020年12月22日

此文章未经授权，不得引用或者转发，否则追究法律责任

当日概况

今日掉期市场，各期限价格按成交时间顺序如下（截止 4:30PM）

	早盘	午盘
O/N	+3, +3.05, +2.95, +2.96, +3,	+3.2, +3.1, +3.7,
T/N	+3.3, +3.5, +3.42, +3.38, +3.4,	+3.55, +3.54, +3.5, +3.6,
S/N	+14.5, +14.2,	+13.9, +13.8, +14, +14.5, +14.65,
1W	+25,	+26, +26.5, +27,
2W	+92, +90,	+91,
3W		
1S	+163, +163.5, +164, +168, +166,	+165, +164, +164.5, +164, +165,
2S	+315, +313, +320, +325, +328,	+317, +315.5, +317,
3S	+425, +420, +424, +432, +428,	+425, +426,
4S		
5S		
6S	+786, +782,	+790, +795, +787,
7S		
8S		
9S		+1139,
10S		
11S		
1Y	+1497, +1500, +1502, +1508, +1510, +1505,	+1505, +1495, +1490, +1495, +1500,
18S		
2Y		+3060, +3065, +3060,
3Y		
4Y		
5Y		

今日央行中间价 6.5387 上个交易下降了 120pips。美元/人民币截止晚 4:30 分 spot 6.5480 价格在较上一个交易日价格 6.5494 下降了 14pips。

流动性

昨日资金面整体偏宽松。

今日市场流动性资金面总体较为宽松；美金宽松。今日 7 天逆回购 100 亿，14 天逆回购 1200 亿，逆回购到期 100 亿。

今日早盘掉期

- 超短期方面, ON 成交在 +3, +3.05, +2.95, +2.96, +3, 的位置, TN 成交在 +3.3, +3.5, +3.42, +3.38, +3.4, 位置, SN 成交在 +14.5, +14.2, 的位置。
- 短期方面, 1W 成交在 +25, 的位置, 2W 成交在 +92, +90, 的位置, 1S 成交在 +163, +163.5, +164, +168, +166, 的位置, 2S 成交在 +315, +313, +320, +325, +328, 的位置。
- 中长期方面, 3S 成交在 +425, +420, +424, +432, +428, 的位置, 6S 成交在 +786, +782, 的位置。
- 长期方面, 1Y 成交在 +1497, +1500, +1502, +1508, +1510, +1505, 的位置。
- 超长期方面, 早盘无成交。

今日午盘掉期

- 超短期方面置, ON 成交在 +3.2, +3.1, +3.7, 的位置, TN 成交在 +3.55, +3.54, +3.5, +3.6, 的位置, SN 成交在 +13.9, +13.8, +14, +14.5, +14.65, 的位置。
- 短期方面, 1W 成交在 +26, +26.5, +27, 的位置, 2W 成交在 +91, 的位置, 1S 成交在 +165, +164, +164.5, +164, +165, 的位置, 2S 成交在 +317, +315.5, +317, 的位置。
- 中长期方面, 3S 成交在 +425, +426, 的位置, 6S 成交在 +790, +795, +787, 的位置。
- 长期方面, 9S 成交在 +1139, 的位置, 1Y 成交在 +1505, +1495, +1490, +1495, +1500, 的位置。
- 超长期方面, 2Y 成交在 +3060, +3065, +3060, 的位置。

当日市场价格
(截止 4: 30PM)

USD/CNY					
FIXING	6.5387		CLOSING	6.5480	
SWAP			FORWARD		
TENOR	BID	ASK	TENOR	BID	ASK
O/N	2.50	4.00	O/N	2.50	4.00
T/N	2.50	4.00	T/N	2.50	4.00
S/N	13.00	15.00	S/N	13.00	15.00
1W	23.00	28.00	1 W	23.00	28.00
2W	89.00	96.00	2 W	89.00	96.00
1M	162.00	168.00	1 M	162.00	168.00
2M	315.00	325.00	2 M	315.00	325.00
3M	420.00	430.00	3 M	420.00	430.00
4M	520.00	570.00	4 M	520.00	570.00
5M	620.00	670.00	5 M	620.00	670.00
6M	775.00	795.00	6 M	775.00	795.00
9M	1130.00	1150.00	9 M	1130.00	1150.00
1Y	1490.00	1505.00	1 Y	1490.00	1505.00
15M	1750.00	1950.00	15M	1750.00	1950.00
18M	2170.00	2290.00	18M	2170.00	2290.00
2Y	3000.00	3150.00	2 Y	3000.00	3150.00
3Y	4500.00	4700.00	3 Y	4500.00	4700.00
OUTRIGHT			SWP/FWD		
TENOR	TENOR	TENOR	TENOR	BID	ASK
O/N	6.54275	6.55260			
T/N	6.54275	6.55260			
S/N	6.54430	6.55450			
1W	6.5453	6.5558	1W*2W	61.00	73.00
2W	6.5519	6.5626	1W*1M	134.00	145.00
1M	6.5592	6.5698	2W*1M	66.00	79.00
2M	6.5745	6.5855	1M*2M	147.00	163.00
3M	6.5850	6.5960	1M*3M	252.00	268.00
4M	6.5950	6.6100	1M*6M	607.00	633.00
5M	6.6050	6.6200	1M*9M	962.00	988.00
6M	6.6205	6.6325	1M*1Y	1322.00	1343.00
9M	6.6560	6.6680	2M*3M	95.00	115.00
1Y	6.6920	6.7035	2M*5M	295.00	355.00
15M	6.7180	6.7480	2M*6M	450.00	480.00

18M	6.7600	6.7820	2M*9M	805.00	835.00
2Y	6.8430	6.8680	2M*1Y	1165.00	1190.00
3Y	6.9930	7.0230	3M*4M	90.00	150.00

数据来源: Tullett Prebon SITICO(China)
路透代码: TPSC

感谢对我们公司的关注!

本简评仅供参考, 不代表任何交易建议。

外汇市场部