

## 外汇市场每日简评

### 2018年1月12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	+13.3, +13, +12.7, +12, +11.3	+11.9, +11.95
T/N		
S/N	+3	+2.94, +2.9
1W		+21
2W		
3W		
1S		+151
2S		+220, +225
3S	+324	+322, +327
4s		
5S		
6S	+580, +579	+570, +575, +574, +577, +583, +584
9S		+799
1Y	+1010, +1005	+1000, +1005, +1008, +995, +996, +999, +1015
2Y		

其他期限没有成交。

今日央行中间价在 6.4932，较上个交易日下降了 215pips。美元/人民币截止晚 4:30 分 spot 价格在 6.4680 较上一个交易日价格 6.5088，下降了 408pips。

#### 流动性

昨日市场资金面呈紧平衡态势。

今日早些人民币资金略紧；美金短期宽松，6s-1y 期限略紧。央行逆回购到期 900 亿。

今日央行公开市场进行 7 天逆回购 1400 亿，14 天逆回购 1300 亿，逆回购到期 900 亿。

### 今日早盘掉期

- 超短期方面，ON 成交在+3.5，+3.6，+3 的位置，TN 成交在+13.75，+13.7，+14.3，+14.4，+14，+13.77 的位置，SN 成交在+3.4 的位置。
- 短期方面，1W 成交在+25 的位置，1S 成交在+170，+168 的位置，2S 成交在+243 的位置，3S 成交在+335 的位置。
- 中长期方面，6S 成交在+598，+593.5，+595 的位置，9S 成交在+830，+823.5，+829 的位置。
- 长期方面，1Y 成交在+1070，+1060，+1057，+1035，+1039，+1040 的位置。

### 今日掉期午盘

- 超短期方面，TN 成交在+11.89 的位置，SN 成交在+3.29，+3.15 的位置。
- 短期方面，2W 成交在+49，+47.8，+46.8，+46.5 的位置，3W 成交在+71 的位置，1S 成交在+158，+159 的位置，2S 成交在+231，+234 的位置，3S 成交在+335 的位置。
- 中长期方面，6S 成交在+585，+589，+590，+593 的位置。
- 长期方面，1Y 成交在+1030，+1032，+1033，+1031，+1028，+1025 的位置。

### 当日市场价格

(截止 4: 30PM)

USD/CNY					
FIXING	6.5147		CLOSING	6.5088	
SWAP			FORWARD		
TENOR	BID	ASK	TENOR	BID	ASK
O/N	2.50	3.50	O/N	2.50	3.50
T/N	11.00	12.00	T/N	11.00	12.00
S/N	3.10	3.20	S/N	3.10	3.20
1W	22.00	23.50	1 W	22.00	23.50
2W	45.00	47.00	2 W	45.00	47.00
1M	155.00	160.00	1 M	155.00	160.00
2M	225.00	235.00	2 M	225.00	235.00
3M	325.00	335.00	3 M	325.00	335.00
4M	420.00	445.00	4 M	420.00	445.00

<b>5M</b>	<b>500.00</b>	<b>535.00</b>	<b>5 M</b>	<b>500.00</b>	<b>535.00</b>
<b>6M</b>	<b>580.00</b>	<b>585.00</b>	<b>6 M</b>	<b>580.00</b>	<b>585.00</b>
<b>9M</b>	<b>810.00</b>	<b>820.00</b>	<b>9 M</b>	<b>810.00</b>	<b>820.00</b>
<b>1Y</b>	<b>1020.00</b>	<b>1028.00</b>	<b>1 Y</b>	<b>1020.00</b>	<b>1028.00</b>
<b>15M</b>	<b>1290.00</b>	<b>1315.00</b>	<b>15M</b>	<b>1290.00</b>	<b>1315.00</b>
<b>18M</b>	<b>1460.00</b>	<b>1530.00</b>	<b>18M</b>	<b>1460.00</b>	<b>1530.00</b>
<b>2Y</b>	<b>1900.00</b>	<b>2080.00</b>	<b>2 Y</b>	<b>1900.00</b>	<b>2080.00</b>
<b>3Y</b>	<b>3120.00</b>	<b>3320.00</b>	<b>3 Y</b>	<b>3120.00</b>	<b>3320.00</b>
<b>OUTRIGHT</b>			<b>SWP/FWD</b>		
<b>TENOR</b>	<b>TENOR</b>	<b>TENOR</b>	<b>TENOR</b>	<b>BID</b>	<b>ASK</b>
<b>O/N</b>	<b>6.51785</b>	<b>6.52060</b>			
<b>T/N</b>	<b>6.51765</b>	<b>6.52063</b>			
<b>S/N</b>	<b>6.51940</b>	<b>6.52250</b>			
<b>1W</b>	<b>6.5205</b>	<b>6.5236</b>	<b>1W*2W</b>	<b>21.50</b>	<b>25.00</b>
<b>2W</b>	<b>6.5229</b>	<b>6.5263</b>	<b>1W*1M</b>	<b>131.50</b>	<b>138.00</b>
<b>1M</b>	<b>6.5293</b>	<b>6.5325</b>	<b>2W*1M</b>	<b>108.00</b>	<b>115.00</b>
<b>2M</b>	<b>6.5424</b>	<b>6.5458</b>	<b>1M*2M</b>	<b>65.00</b>	<b>80.00</b>
<b>3M</b>	<b>6.5520</b>	<b>6.5557</b>	<b>1M*3M</b>	<b>165.00</b>	<b>180.00</b>
<b>4M</b>	<b>6.5600</b>	<b>6.5655</b>	<b>1M*6M</b>	<b>420.00</b>	<b>430.00</b>
<b>5M</b>	<b>6.5680</b>	<b>6.5745</b>	<b>1M*9M</b>	<b>650.00</b>	<b>665.00</b>
<b>6M</b>	<b>6.5775</b>	<b>6.5820</b>	<b>1M*1Y</b>	<b>860.00</b>	<b>873.00</b>
<b>9M</b>	<b>6.6005</b>	<b>6.6060</b>	<b>2M*3M</b>	<b>90.00</b>	<b>110.00</b>
<b>1Y</b>	<b>6.6230</b>	<b>6.6265</b>	<b>2M*5M</b>	<b>265.00</b>	<b>310.00</b>
<b>15M</b>	<b>6.6470</b>	<b>6.6525</b>	<b>2M*6M</b>	<b>345.00</b>	<b>360.00</b>
<b>18M</b>	<b>6.6700</b>	<b>6.6770</b>	<b>2M*9M</b>	<b>575.00</b>	<b>595.00</b>
<b>2Y</b>	<b>6.7080</b>	<b>6.7350</b>	<b>2M*1Y</b>	<b>785.00</b>	<b>803.00</b>
<b>3Y</b>	<b>6.8300</b>	<b>6.8560</b>	<b>3M*4M</b>	<b>85.00</b>	<b>120.00</b>

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