

外汇市场每日简评

2020年11月24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	+3.5, +3.6, +3.8, +4, +3.8,	
T/N	+6.6, +6.5, +6.4, +6.3, +6.1, +6.2, +6.3, +6.26, +6.25, +6.26, +6.2, +6, +5.5, +5.55,	+5.7, +5.9, +5.7,
S/N	+9.1, +9, +9.1,	+9.18, +9.4, +9.2, +9.35, +9.4, +9.28,
1W	+38, +40,	+41, +40.5,
2W		+75, +74,
3W		
1S	+158, +157,	+160, +161, +162, +161,
2S		+380, +382,
3S	+570,	+573.5, +575, +576, +577,
4S		
5S		
6S	+985, +990,	+1000,
7S		
8S		
9S		
10S		
11S		
1Y	+1805, +1810, +1808, +1800, +1805, +1808,	+1811, +1813, +1818, +1820, +1821, +1820
18S		
2Y		
3Y		
4Y		
5Y		

今日央行中间价 6.5809 上个交上涨了 90pips。 美元/人民币截止晚 4:30 分 spot 6.5761 价格在较上一个交易日价格 6.5694 上涨了 67pips。

流动性

昨日资金面日间整体偏宽松、尾盘骤紧。

今日市场流动性资金面总体较为平衡；美金宽松。7天逆回购700亿，逆回购到期500亿。

今日早盘掉期

- 超短期方面, 0N 成交在+3.5, +3.6, +3.8, +4, +3.8, 的位置, TN 成交在+6.6, +6.5, +6.4, +6.3, +6.1, +6.2, +6.3, +6.26, +6.25, +6.26, +6.2, +6, +5.5, +5.55, 的位置, SN 成交在+9.1, +9, +9.1, 的位置。
- 短期方面, 1W 成交在+38, +40, 的位置, 1S 成交在+158, +157, 的位置。
- 中长期方面, 3S 成交在+570, 的位置, 6S 成交在+985, +990, 的位置。
- 长期方面, 1Y 成交在+1805, +1810, +1808, +1800, +1805, +1808, 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, TN 成交在+5.7, +5.9, +5.7, 的位置, SN 成交在+9.18, +9.4, +9.2, +9.35, +9.4, +9.28, 的位置。
- 短期方面, 1W 成交在+41, +40.5, 的位置, 2W 成交在+75, +74, 的位置, 1S 成交在+160, +161, +162, +161, 的位置, 2S 成交在+380, +382, 的位置。
- 中长期方面, 3S 成交在+573.5, +575, +576, +577, 的位置, 6S 成交在+1000, 的位置。
- 长期方面, 1Y 成交在+1811, +1813, +1818, +1820, +1821, +1820 的位置。
- 超长期方面, 午盘无成交。

当日市场价格

(截止 4: 30PM)

USD/CNY					
FIXING	6.5809		CLOSING	6.5761	
SWAP			FORWARD		
TENOR	BID	ASK	TENOR	BID	ASK
O/N	3.00	4.50	O/N	3.00	4.50
T/N	5.00	6.00	T/N	5.00	6.00

S/N	8.00	10.00	S/N	8.00	10.00
1W	38.00	44.00	1 W	38.00	44.00
2W	72.00	80.00	2 W	72.00	80.00
1M	158.00	165.00	1 M	158.00	165.00
2M	375.00	385.00	2 M	375.00	385.00
3M	570.00	585.00	3 M	570.00	585.00
4M	700.00	735.00	4 M	700.00	735.00
5M	845.00	870.00	5 M	845.00	870.00
6M	995.00	1005.00	6 M	995.00	1005.00
9M	1390.00	1410.00	9 M	1390.00	1410.00
1Y	1815.00	1825.00	1 Y	1815.00	1825.00
15M	2150.00	2300.00	15M	2150.00	2300.00
18M	2600.00	2700.00	18M	2600.00	2700.00
2Y	3500.00	3600.00	2 Y	3500.00	3600.00
3Y	5250.00	5500.00	3 Y	5250.00	5500.00
OUTRIGHT			SWP/FWD		
TENOR	TENOR	TENOR	TENOR	BID	ASK
O/N	6.57270	6.58255			
T/N	6.57250	6.58240			
S/N	6.57380	6.58400			
1W	6.5768	6.5874	1W*2W	28.00	42.00
2W	6.5802	6.5910	1W*1M	114.00	127.00
1M	6.5888	6.5995	2W*1M	78.00	93.00
2M	6.6105	6.6215	1M*2M	210.00	227.00
3M	6.6300	6.6415	1M*3M	405.00	427.00
4M	6.6430	6.6565	1M*6M	830.00	847.00
5M	6.6575	6.6700	1M*9M	1225.00	1252.00
6M	6.6725	6.6835	1M*1Y	1650.00	1667.00
9M	6.7120	6.7240	2M*3M	185.00	210.00
1Y	6.7545	6.7655	2M*5M	460.00	495.00
15M	6.7880	6.8130	2M*6M	610.00	630.00
18M	6.8330	6.8530	2M*9M	1005.00	1035.00
2Y	6.9230	6.9430	2M*1Y	1430.00	1450.00
3Y	7.0980	7.1330	3M*4M	115.00	165.00

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