

外汇市场每日简评

2020年12月25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		
T/N	3.5, 3.3, 3.32,	3.3, 3.27, 3.1
S/N	3.25, 3.4,	3.36 3.4, 3.43
1W		57, 58, 59, 60
2W		
3W		
1S		156, 155, 157,
2S		
3S	410	
4S		
5S		
6S		775, 778, 780
7S		
8S		
9S		
10S		
11S		1135
1Y	1488 1490	1500 1498 1502
18S		
2Y		
3Y		
4Y		
5Y		

今日央行中间价 6.5333 上个交易日下降了 28pips。美元/人民币截止晚 4:30 分 spot 6.5320 价格在较上一个交易日价格 6.5320 下降了 41pips。

流动性

昨日资金面总体较为宽松。

今日市场流动性资金面总体较为宽松；美金宽松。7天逆回购400亿，逆回购到期100亿。

今日早盘掉期

- 超短期方面, TN 成交在+3.5, +3.32, +3.3 的位置, SN 成交在+3.25, +3.4 的位置。
- 短期方面, 早盘无成交。
- 中长期方面, 3S 成交在+410 的位置。
- 长期方面, 1Y 成交在+1488, +1490 的位置。
- 超长期方面, 早盘无成交。

今日午盘掉期

- 超短期方面, TN 成交在+3.3, 3.27 的位置, SN 成交在+3.43, +3.4, +3.36 的位置。
- 短期方面, 1W 成交在+57, +58, +59, +60 的位置, 1S 成交在+157, +156, +155 的位置。
- 中长期方面, 3S 成交在+410, +412, +409 的位置, 6S 成交在+775, +778, +780 的位置。
- 长期方面, 9S 成交在+1135 的位置。1Y 成交在+1500, +1498, +1502 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	6.5361		CLOSING	6.5320	
SWAP			FORWARD		
TENOR	BID	ASK	TENOR	BID	ASK
O/N	4.00	8.00	O/N	4.00	8.00
T/N			T/N	0.00	0.00
S/N	2.00	3.50	S/N	2.00	3.50

1W	55.00	62.00	1 W	55.00	62.00
2W	80.00	90.00	2 W	80.00	90.00
1M	150.00	160.00	1 M	150.00	160.00
2M	290.00	305.00	2 M	290.00	305.00
3M	405.00	415.00	3 M	405.00	415.00
4M	512.00	530.00	4 M	512.00	530.00
5M	620.00	660.00	5 M	620.00	660.00
6M	760.00	780.00	6 M	760.00	780.00
9M	1115.00	1130.00	9 M	1115.00	1130.00
1Y	1470.00	1485.00	1 Y	1470.00	1485.00
15M	1750.00	1950.00	15M	1750.00	1950.00
18M	2150.00	2270.00	18M	2150.00	2270.00
2Y	3000.00	3120.00	2 Y	3000.00	3120.00
3Y	4500.00	4700.00	3 Y	4500.00	4700.00
OUTRIGHT			SWP/FWD		
TENOR	TENOR	TENOR	TENOR	BID	ASK
O/N	6.52660	6.53620			
T/N	6.52700	6.53700			
S/N	6.52720	6.53735			
1W	6.5325	6.5432	1W*2W	18.00	35.00
2W	6.5350	6.5460	1W*1M	88.00	105.00
1M	6.5420	6.5530	2W*1M	60.00	80.00
2M	6.5560	6.5675	1M*2M	130.00	155.00
3M	6.5675	6.5785	1M*3M	245.00	265.00
4M	6.5782	6.5900	1M*6M	600.00	630.00
5M	6.5890	6.6030	1M*9M	955.00	980.00
6M	6.6030	6.6150	1M*1Y	1310.00	1335.00
9M	6.6385	6.6500	2M*3M	100.00	125.00
1Y	6.6740	6.6855	2M*5M	315.00	370.00
15M	6.7020	6.7320	2M*6M	455.00	490.00
18M	6.7420	6.7640	2M*9M	810.00	840.00
2Y	6.8270	6.8490	2M*1Y	1165.00	1195.00
3Y	6.9770	7.0070	3M*4M	97.00	125.00

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