

外汇市场每日简评

2019年08月09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	+2. 7,	
T/N	+1. 1, +1. 17, +1,	+0. 9,
S/N		+0. 73, +0. 7, +0. 75
1W	+6,	+5. 8, +5. 7, +5. 4,
2W		+13,
3W		
1S	+26	+25, +21, +22, +23,
2S	+45,	+41, +44,
3S	+59, +65,	+64. 5, +63, +62, +61, +58, +62,
4S		
5S		
6S	+135, +140,	+140, +130,
9S		
10S		
11S		
1Y	+280, +295, +300, +310, +300, +295, +300 +305,	+295, +288,
18S		
2Y		
3Y		

今日央行中间价 7. 0136 上个交易日上升了 97pips。 美元/人民币截止晚 4: 30 分 spot 7. 0520 价格在较上一个交易日价格 7. 0443 上升了 77pips。

流动性

昨天资金面总体呈平衡态势。

今日市场流动性有所趋紧；美金均衡。中国央行 8 月 9 日无逆回购操作，逆回购没有到期。

今日早盘掉期

- 超短期方面，ON 成交在+2.7, 的位置, TN 成交在+1.1, +1.17, +1, 的位置。
- 短期方面，1W 成交在+6, 的位置。
- 中长期方面，1S 成交在+26 的位置，2S 成交在+45, 的位置，3S 成交在+59, +65, 的位置，6S 成交在+135, +140, 的位置。
- 长期方面，1Y 成交在+280, +295, +300, +310, +300, +295, +300, +305, 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+0.9, 的位置, SN 成交在+0.73, +0.7, +0.75 的位置。
- 短期方面，1W 成交在+5.8, +5.7, +5.4, 的位置, 2W 成交在+13, 的位置。
- 中长期方面，1S 成交在+25, +21, +22, +23, 的位置, 2S 成交在+41, +44, 的位置，3S 成交在+64.5, +63, +62, +61, +58, +62, 的位置, 6S 成交在+140, +130, 的位置。
- 长期方面，1Y 成交在+295, +288, 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	7.0136		CLOSING	7.0520	
SWAP			FORWARD		
TENOR	BID	ASK	TENOR	BID	ASK
O/N	1.00	2.50	O/N	1.00	2.50
T/N	0.70	1.00	T/N	0.70	1.00
S/N	0.60	0.90	S/N	0.60	0.90
1W	5.00	5.50	1 W	5.00	5.50
2W	11.00	15.00	2 W	11.00	15.00
1M	21.00	25.00	1 M	21.00	25.00
2M	42.00	45.00	2 M	42.00	45.00
3M	61.00	65.00	3 M	61.00	65.00
4M	75.00	90.00	4 M	75.00	90.00
5M	85.00	110.00	5 M	85.00	110.00
6M	125.00	135.00	6 M	125.00	135.00

9M	195.00	215.00	9 M	195.00	215.00
1Y	285.00	295.00	1 Y	285.00	295.00
15M	410.00	480.00	15M	410.00	480.00
18M	550.00	620.00	18M	550.00	620.00
2Y	1000.00	1150.00	2 Y	1000.00	1150.00
3Y	2100.00	2200.00	3 Y	2100.00	2200.00
OUTRIGHT			SWP/FWD		
TENOR	TENOR	TENOR	TENOR	BID	ASK
O/N	7.04690	7.05675			
T/N	7.04693	7.05690			
S/N	7.04706	7.05709			
1W	7.0475	7.0576	1W*2W	5.50	10.00
2W	7.0481	7.0585	1W*1M	15.50	20.00
1M	7.0491	7.0595	2W*1M	6.00	14.00
2M	7.0512	7.0615	1M*2M	17.00	24.00
3M	7.0531	7.0635	1M*3M	36.00	44.00
4M	7.0545	7.0660	1M*6M	100.00	114.00
5M	7.0555	7.0680	1M*9M	170.00	194.00
6M	7.0595	7.0705	1M*1Y	260.00	274.00
9M	7.0665	7.0785	2M*3M	16.00	23.00
1Y	7.0755	7.0865	2M*5M	40.00	68.00
15M	7.0880	7.1050	2M*6M	80.00	93.00
18M	7.1020	7.1190	2M*9M	150.00	173.00
2Y	7.1470	7.1720	2M*1Y	240.00	253.00
3Y	7.2570	7.2770	3M*4M	10.00	29.00

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