

外汇市场每日简评

2019年08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	+1.2, +1, +0.9, +0.7, +0.75,	
T/N	+1, +1.1, +0.75, +0.7, +0.75, +0.5	+0.46, +0.4,
S/N	+0.6,	+0.67,
1W		+4.5, +4.4, +4.7,
2W		+9.5, +9.75, +9.8,
3W		
1S	+24, +21, +20, +22, +21.5,	+21.5, +21, +21.3, +21,
2S	+45,	+42,
3S	+58, +60, +63, +62,	
4S		
5S		
6S	+123, +125, +129,	+128, +126, +125,
9S		
10S		
11S		
1Y	+280,	+280, +278, +276, +278,
18S		
2Y		
3Y		

今日央行中间价 7.0211 上个交易日上升了 75pips。美元/人民币截止晚 4:30 分 spot 7.0679 价格在较上一个交易日价格 7.0520 上升了 159pips。

流动性

上周五资金面整体略显偏紧。

今日市场流动性较为紧张；美金均衡。7 天逆回购 300 亿，逆回购没有到期。

今日早盘掉期

- 超短期方面，ON 成交在+1.2, +1, +0.9, +0.7, +0.75, 的位置, TN 成交在+1, +1.1, +0.75, +0.7, +0.75, +0.5 的位置, SN 成交在+0.6, 的位置。
- 短期方面，早盘无成交。
- 中长期方面，1S 成交在+24, +21, +20, +22, +21.5, 的位置, 2S 成交在+45, 的位置, 3S 成交在+58, +60, +63, +62, 的位置, 6S 成交在+123, +125, +129, 的位置。
- 长期方面，1Y 成交在+280, 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+0.46, +0.4, 的位置, SN 成交在+0.67, 的位置。
- 短期方面，1W 成交在+4.5, +4.4, +4.7, 的位置, 2W 成交在+9.5, +9.75, +9.8, 的位置。
- 中长期方面，1S 成交在+21.5, +21, +21.3, +21, 的位置, 2S 成交在+42, 的位置, 6S 成交在+128, +126, +125, 的位置。
- 长期方面，1Y 成交在+280, +278, +276, +278, 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		7.0211	CLOSING		7.0679
SWAP			FORWARD		
TENOR	BID	ASK	TENOR	BID	ASK
O/N	0.50	1.50	O/N	0.50	1.50
T/N	0.40	0.70	T/N	0.40	0.70
S/N	0.60	0.80	S/N	0.60	0.80
1W	4.50	5.00	1 W	4.50	5.00
2W	9.00	10.00	2 W	9.00	10.00
1M	20.00	23.00	1 M	20.00	23.00
2M	40.00	43.00	2 M	40.00	43.00
3M	60.00	65.00	3 M	60.00	65.00
4M	80.00	90.00	4 M	80.00	90.00

5M	95.00	110.00	5 M	95.00	110.00
6M	120.00	130.00	6 M	120.00	130.00
9M	185.00	205.00	9 M	185.00	205.00
1Y	270.00	285.00	1 Y	270.00	285.00
15M	390.00	450.00	15M	390.00	450.00
18M	510.00	600.00	18M	510.00	600.00
2Y	950.00	1100.00	2 Y	950.00	1100.00
3Y	2050.00	2250.00	3 Y	2050.00	2250.00
OUTRIGHT			SWP/FWD		
TENOR	TENOR	TENOR	TENOR	BID	ASK
O/N	7.06395	7.07185			
T/N	7.06396	7.07193			
S/N	7.06406	7.07208			
1W	7.0645	7.0725	1W*2W	4.00	5.50
2W	7.0649	7.0730	1W*1M	15.00	18.50
1M	7.0660	7.0743	2W*1M	10.00	14.00
2M	7.0680	7.0763	1M*2M	17.00	23.00
3M	7.0700	7.0785	1M*3M	37.00	45.00
4M	7.0720	7.0810	1M*6M	97.00	110.00
5M	7.0735	7.0830	1M*9M	162.00	185.00
6M	7.0760	7.0850	1M*1Y	247.00	265.00
9M	7.0825	7.0925	2M*3M	17.00	25.00
1Y	7.0910	7.1005	2M*5M	52.00	70.00
15M	7.1030	7.1170	2M*6M	77.00	90.00
18M	7.1150	7.1320	2M*9M	142.00	165.00
2Y	7.1590	7.1820	2M*1Y	227.00	245.00
3Y	7.2690	7.2970	3M*4M	15.00	30.00

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