

外汇市场每日简评

2019年08月14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	+0.7, +1.2, +1.3, +2,	
T/N	+0.8, +0.85, +1, +1.02, +1.01, +1.02,	+1,
S/N	+2.4,	+2.55,
1W	+5.85,	+5.9,
2W		
3W		+17,
1S	+22, +21, +22,	+22.5, +23,
2S	+42,	+43.5, +45,
3S	+61, +60, +61,	+62, +63, +64
4S		
5S		
6S	+125,	+125,
9S	+195,	+195,
10S		
11S		
1Y	+275, +270, +268,	+268, +265, +268, +269,
18S	+580,	
2Y		
3Y		

今日央行中间价 7.0312 上个交易日下降了 14pips。美元/人民币截止晚 4:30 分 spot 7.0165 价格在较上一个交易日价格 7.0669 下降了 504pips。

流动性

昨天资金面总体偏紧。

今日市场流动性较为紧张；美金均衡。7 天逆回购 1000 亿，逆回购没有到期。

今日早盘掉期

- 超短期方面，ON 成交在+0.7, +1.2, +1.3, +2, 的位置, TN 成交在+0.8, +0.85, +1, +1.02, +1.01, +1.02, 的位置, SN 成交在+2.4, 的位置。
- 短期方面，1W 成交在+5.85, 的位置。
- 中长期方面，1S 成交在+22, +21, +22, 的位置, 2S 成交在+42, 的位置, 3S 成交在+61, +60, +61, 的位置, 6S 成交在+125, 的位置。
- 长期方面，9S 成交在+195, 的位置, 1Y 成交在+275, +270, +268, 的位置。
- 超长期方面，18S 成交在+580, 的位置。

今日午盘掉期

- 超短期方, TN 成交在+1, 的位置, SN 成交在+2.55, 的位置。
- 短期方面，1W 成交在+5.9, 的位置, 3W 成交在+17, 的位置。
- 中长期方面，1S 成交在+22.5, +23, 的位置, 2S 成交在+43.5, +45, 的位置, 3S 成交在+62, +63, +64 的位置, 6S 成交在+125, 的位置。
- 长期方面, 9S 成交在+195, 的位置, 1Y 成交在+268, +265, +268, +269, 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	7.0312		CLOSING	7.0165	
SWAP			FORWARD		
TENOR	BID	ASK	TENOR	BID	ASK
O/N	1.00	2.00	O/N	1.00	2.00
T/N	0.90	1.10	T/N	0.90	1.10
S/N	2.50	2.70	S/N	2.50	2.70
1W	5.80	6.00	1 W	5.80	6.00
2W	11.00	13.00	2 W	11.00	13.00
1M	20.00	25.00	1 M	20.00	25.00
2M	42.00	45.00	2 M	42.00	45.00
3M	60.00	65.00	3 M	60.00	65.00
4M	75.00	85.00	4 M	75.00	85.00
5M	95.00	110.00	5 M	95.00	110.00

6M	120.00	130.00	6 M	120.00	130.00
9M	190.00	200.00	9 M	190.00	200.00
1Y	265.00	275.00	1 Y	265.00	275.00
15M	370.00	440.00	15M	370.00	440.00
18M	550.00	600.00	18M	550.00	600.00
2Y	1000.00	1050.00	2 Y	1000.00	1050.00
3Y	2000.00	2150.00	3 Y	2000.00	2150.00
OUTRIGHT			SWP/FWD		
TENOR	TENOR	TENOR	TENOR	BID	ASK
O/N	7.01090	7.01880			
T/N	7.01091	7.01889			
S/N	7.01125	7.01927			
1W	7.0116	7.0196	1W*2W	5.00	7.20
2W	7.0121	7.0203	1W*1M	14.00	19.20
1M	7.0130	7.0215	2W*1M	7.00	14.00
2M	7.0152	7.0235	1M*2M	17.00	25.00
3M	7.0170	7.0255	1M*3M	35.00	45.00
4M	7.0185	7.0275	1M*6M	95.00	110.00
5M	7.0205	7.0300	1M*9M	165.00	180.00
6M	7.0230	7.0320	1M*1Y	240.00	255.00
9M	7.0300	7.0390	2M*3M	15.00	23.00
1Y	7.0375	7.0465	2M*5M	50.00	68.00
15M	7.0480	7.0630	2M*6M	75.00	88.00
18M	7.0660	7.0790	2M*9M	145.00	158.00
2Y	7.1110	7.1240	2M*1Y	220.00	233.00
3Y	7.2110	7.2340	3M*4M	10.00	25.00

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