

## 外汇市场每日简评

### 2020年12月21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	+1.5, +1, +1.6, +2.5, +2.8, +2.7,	
T/N	+2.3, +1.95, +2.1, +2.2,	+2.4, +2.5, +3, +3.05, +3.2,
S/N	+2.56, +2.4, +2.45, +2.55, +2.5,	+2.85, +3,
1W	+23, +24.5,	
2W		
3W		
1S	+153, +154, +155, +156,	+158, +160,
2S		
3S	+405, +410,	+417, +419, +417, +418, +420,
4S	+528,	
5S		
6S		+784, +787, +785, +787, +788, +790,
7S		
8S		
9S		
10S		
11S		
1Y	+1490, +1498,	+1500, +1503, +1508, +1509,
18S		
2Y		
3Y		
4Y		
5Y		

今日央行中间价 6.5507 上个交易上涨了 192pips。美元/人民币截止晚 4:30 分 spot 6.5494 价格在较上一个交易日价格 6.5415 上涨了 79pips。

#### 流动性

上周五资金面整体逐渐转松。

今日市场流动性资金面总体较为平衡；美金宽松。今日 7 天逆回购 100 亿，14 天逆回购 1000 亿，逆回购到期 200 亿。

### 今日早盘掉期

- 超短期方面, 0N 成交在+1.5, +1, +1.6, +2.5, +2.8, +2.7, 的位置, TN 成交在 +2.3, +1.95, +2.1, +2.2, 位置, SN 成交在+2.56, +2.4, +2.45, +2.55, +2.5, 的位置。
- 短期方面, 1W 成交在+23, +24.5, 的位置, 1S 成交在+153, +154, +155, +156, 的位置。
- 中长期方面, 3S 成交在+405, +410, 的位置, 4S 成交在+528, 的位置。
- 长期方面, 1Y 成交在+1490, +1498, 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+2.4, +2.5, +3, +3.05, +3.2, 的位置, SN 成交在 +2.85, +3, 的位置。
- 短期方面, 1S 成交在+158, +160, 的位置。
- 中长期方面, 3S 成交在+417, +419, +417, +418, +420, 的位置, 6S 成交在 +784, +787, +785, +787, +788, +790, 的位置。
- 长期方面, 1Y 成交在+1500, +1503, +1508, +1509, 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	6.5507		CLOSING	6.5494	
SWAP			FORWARD		
TENOR	BID	ASK	TENOR	BID	ASK
O/N	2.00	4.00	O/N	2.00	4.00
T/N	2.50	3.50	T/N	2.50	3.50
S/N	2.50	3.50	S/N	2.50	3.50

<b>1W</b>	<b>23.00</b>	<b>28.00</b>	<b>1 W</b>	<b>23.00</b>	<b>28.00</b>
<b>2W</b>	<b>85.00</b>	<b>95.00</b>	<b>2 W</b>	<b>85.00</b>	<b>95.00</b>
<b>1M</b>	<b>158.00</b>	<b>165.00</b>	<b>1 M</b>	<b>158.00</b>	<b>165.00</b>
<b>2M</b>	<b>300.00</b>	<b>310.00</b>	<b>2 M</b>	<b>300.00</b>	<b>310.00</b>
<b>3M</b>	<b>415.00</b>	<b>425.00</b>	<b>3 M</b>	<b>415.00</b>	<b>425.00</b>
<b>4M</b>	<b>538.00</b>	<b>556.00</b>	<b>4 M</b>	<b>538.00</b>	<b>556.00</b>
<b>5M</b>	<b>630.00</b>	<b>675.00</b>	<b>5 M</b>	<b>630.00</b>	<b>675.00</b>
<b>6M</b>	<b>785.00</b>	<b>795.00</b>	<b>6 M</b>	<b>785.00</b>	<b>795.00</b>
<b>9M</b>	<b>1145.00</b>	<b>1160.00</b>	<b>9 M</b>	<b>1145.00</b>	<b>1160.00</b>
<b>1Y</b>	<b>1500.00</b>	<b>1520.00</b>	<b>1 Y</b>	<b>1500.00</b>	<b>1520.00</b>
<b>15M</b>	<b>1750.00</b>	<b>1950.00</b>	<b>15M</b>	<b>1750.00</b>	<b>1950.00</b>
<b>18M</b>	<b>2200.00</b>	<b>2330.00</b>	<b>18M</b>	<b>2200.00</b>	<b>2330.00</b>
<b>2Y</b>	<b>2950.00</b>	<b>3350.00</b>	<b>2 Y</b>	<b>2950.00</b>	<b>3350.00</b>
<b>3Y</b>	<b>4300.00</b>	<b>4700.00</b>	<b>3 Y</b>	<b>4300.00</b>	<b>4700.00</b>
<b>OUTRIGHT</b>			<b>SWP/FWD</b>		
<b>TENOR</b>	<b>TENOR</b>	<b>TENOR</b>	<b>TENOR</b>	<b>BID</b>	<b>ASK</b>
<b>O/N</b>	<b>6.54480</b>	<b>6.55460</b>			
<b>T/N</b>	<b>6.54475</b>	<b>6.55465</b>			
<b>S/N</b>	<b>6.54525</b>	<b>6.55535</b>			
<b>1W</b>	<b>6.5473</b>	<b>6.5578</b>	<b>1W*2W</b>	<b>57.00</b>	<b>72.00</b>
<b>2W</b>	<b>6.5535</b>	<b>6.5645</b>	<b>1W*1M</b>	<b>130.00</b>	<b>142.00</b>
<b>1M</b>	<b>6.5608</b>	<b>6.5715</b>	<b>2W*1M</b>	<b>63.00</b>	<b>80.00</b>
<b>2M</b>	<b>6.5750</b>	<b>6.5860</b>	<b>1M*2M</b>	<b>135.00</b>	<b>152.00</b>
<b>3M</b>	<b>6.5865</b>	<b>6.5975</b>	<b>1M*3M</b>	<b>250.00</b>	<b>267.00</b>
<b>4M</b>	<b>6.5988</b>	<b>6.6106</b>	<b>1M*6M</b>	<b>620.00</b>	<b>637.00</b>
<b>5M</b>	<b>6.6080</b>	<b>6.6225</b>	<b>1M*9M</b>	<b>980.00</b>	<b>1002.00</b>
<b>6M</b>	<b>6.6235</b>	<b>6.6345</b>	<b>1M*1Y</b>	<b>1335.00</b>	<b>1362.00</b>
<b>9M</b>	<b>6.6595</b>	<b>6.6710</b>	<b>2M*3M</b>	<b>105.00</b>	<b>125.00</b>
<b>1Y</b>	<b>6.6950</b>	<b>6.7070</b>	<b>2M*5M</b>	<b>320.00</b>	<b>375.00</b>
<b>15M</b>	<b>6.7200</b>	<b>6.7500</b>	<b>2M*6M</b>	<b>475.00</b>	<b>495.00</b>
<b>18M</b>	<b>6.7650</b>	<b>6.7880</b>	<b>2M*9M</b>	<b>835.00</b>	<b>860.00</b>
<b>2Y</b>	<b>6.8400</b>	<b>6.8900</b>	<b>2M*1Y</b>	<b>1190.00</b>	<b>1220.00</b>
<b>3Y</b>	<b>6.9750</b>	<b>7.0250</b>	<b>3M*4M</b>	<b>113.00</b>	<b>141.00</b>

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