

收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列

NEX 上海国际货币经纪
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2026-01-13】

今日美元/人民币中间价报 7.0103，较上一个交易日下调 5bp，全天掉期市场较为活跃。

O/N 成交在-3.2, -3; T/N 成交在-3.55~-3.45; S/N 成交在-3.58~-3.42; 1w 成交在-24.5; 2w 成交在-49.5; 3w 成交在-73.3, -74.1, -74; 1s 成交在-127, -128.5; 2s 成交在-203, -200, -202.5; 3s 成交在-308。

中长期限，6s 成交在-626, -631.5; 9s 成交在-925; 1y 成交在-1203, -1201, -1200。

Spread 方面，2w*3w 成交在-24.1; 2s*6s 成交在-429; 9s*1y 成交在-278。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-25	6.9740	0.12
2W	14	-50	6.9715	2
1M	40	-130	6.9635	3.4
2M	60	-203	6.9562	5
3M	90	-312	6.9453	1
6M	181	-632	6.9133	-4
9M	273	-930	6.8835	-10
1Y	365	-1209	6.8556	-18
18M	546	-1710	6.8055	-35
2Y	733	-2220	6.7545	-35
3Y	1097	-3225	6.6540	-25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0103	
CLOSING SPOT RATE			6.9765	

USD/CNY Spread Ref.

	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-73	-182	-502	-800	-1079
2M		-109	-429	-727	-1006
3M			-320	-618	-897
6M				-298	-577
9M					-279

Fx Swap Curve



