

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

【2026-01-22】

今日 Fixing 定在 7.0019，较上一交易日上升了 5 个 bp。今日各期限收盘价较上一交易日略微有所上升。

短端，O/N 主要成交在-4.35~-4.1。T/N 主要成交在-13.3~-12.5 的位置。S/N 主要成交在-4.28~-4.02 的位置。1w 成交在-27.5， -27.3， -27.9， -28 等位置。2w 成交在-55， -55.5， -56 的位置。3w 成交在-105， -104.5 等位置。1s 成交在-112， -112.5 等位置。2s 成交在-214， -215 等位置。3s 成交在-331， -332， -332.6 等位置。4s 成交在-435 的位置。

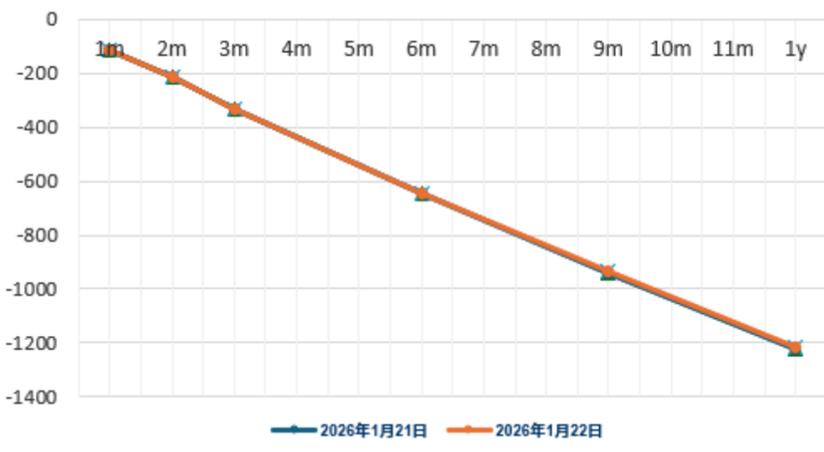
中长期，6s 成交在-645， -644， -646 等位置。9s 成交在-935， -936 等位置。1y 成交在-1205， -1211， -1213， -1211.6， -1215 等位置。

Spread 方面，3w*1s 成交在-7 的位置。5*6s 成交在-101 的位置。6*12s 成交在-569 的位置。3*12s 成交在-879， -880 的位置。9*12s 成交在-278 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-28	6.9600	0.7
2W	14	-56	6.9572	0
1M	31	-113	6.9515	4.1
2M	59	-215	6.9413	2
3M	91	-333	6.9295	-2
6M	182	-646	6.8982	-1
9M	273	-937	6.8691	3
1Y	365	-1215	6.8413	9
18M	546	-1730	6.7898	5
2Y	728	-2260	6.7368	5
3Y	1096	-3300	6.6328	-25
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.0019	
CLOSING SPOT RATE			6.9628	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-102	-220.1	-533.1	-824.1	-1102.1
2M		-118.1	-431.1	-722.1	-1000.1
3M			-313	-604	-882
6M				-291	-569
9M					-278

Fx Swap Curve



免责声明：本日报由上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）制作，版权由上海国际货币所有。未经许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用日报内容。日报所涉及的信息主要来自公开的资料和其他公共渠道，信息不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求，不可作为决策依据，不代表上海国际货币任何推荐或观点，不保证其完整性、时效性或准确性等要求，上海国际货币亦不对因使用本日报任何信息而引发或可能引发的损失或法律纠纷承担任何责任。