

常规报告系列

收盘日评 银行间外汇衍生品市场



【2026-01-15】

今日 Fixing 定在 7.0064，较上一交易日下降了 56 个 bp。今日各期限收盘价较上一交易日有所上升，今日交投较活跃。

短端，O/N 主要成交在-4~3.7 的位置。T/N 主要成交在-15.3~14.7 的位置。S/N 主要成交在-3.75~3.62 的位置。1w 成交在-25.8, -25.6, -25.55 等位置。2w 成交在-48.35, -48.4 的位置。3w 成交在-74 等位置。1s 成交在-111.5, -111.8, -113.2 等位置。2s 成交在-198, -199 等位置。3s 成交在-308, -308.5, -309, -309.2, -310.5 等位置。4s 成交在-418 的位置。5s 成交在-530.5, -530 的位置。

中长期限，6s 成交在-624.5, -625, -626, -627 等位置。9s 成交在-915, -917, -916, -918, -918.5, -920 等位置。1y 成交在-1191, -1195, -1200, -1197 等位置。

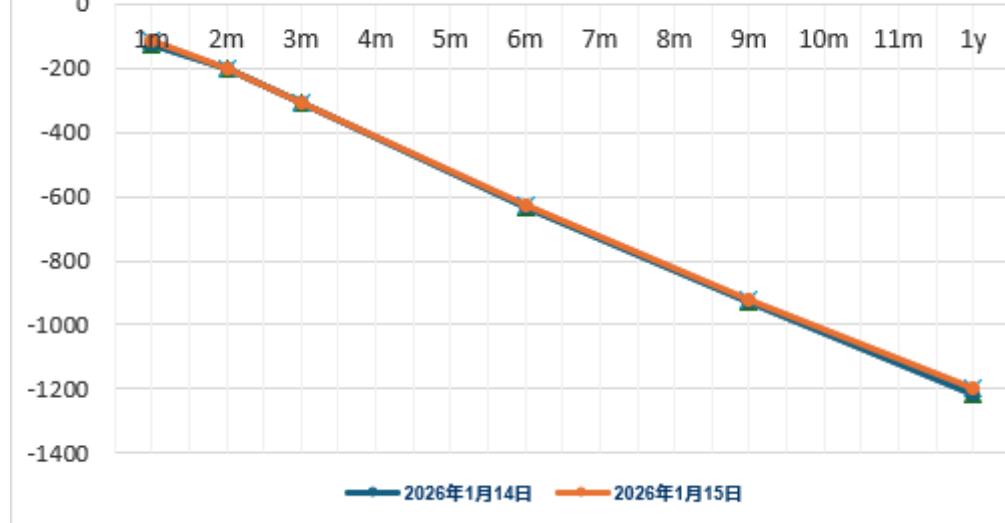
Spread 方面，1*2w 成交在-22.8 的位置。3*6s 成交在-316 的位置。6*9s 成交在-293 的位置。9*12s 成交在 273 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-26	6.9672	-0.16
2W	14	-49	6.9650	2
1M	35	-112	6.9586	13.2
2M	59	-199	6.9499	1
3M	90	-311	6.9388	1
6M	181	-627	6.9071	4
9M	273	-920	6.8779	7.5
1Y	365	-1195	6.8503	20
18M	546	-1695	6.8003	15
2Y	730	-2170	6.7528	41
3Y	1098	-3180	6.6518	45
CNY CENTRAL PARITY RATE		7.0064		
CLOSING SPOT RATE		6.9698		

USD/CNY Spread Ref.

	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-86.9	-198.4	-514.9	-807.4	-1082.9
2M		-111.5	-428	-720.5	-996
3M			-316.5	-609	-884.5
6M				-292.5	-568
9M					-275.5

Fx Swap Curve



免责声明：本日评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、发表或引用日评内容。日评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评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。