

常规报告系列

收盘日评 银行间外汇衍生品市场



【2026-01-12】

今日美元/人民币中间价报 7.0108，较上一个交易日下调 20bp，各期限收盘价较上一交易日有所上行。

ON 成交在-4.2~-2.5；TN 成交在-3.9~-3.22；SN 成交在-3.9~-3.31 之间。

1w 成交在-26~-25 的位置；2w 成交在-52.3，-52 的位置；3w 成交在-75，-74.8 的位置；1s 反复成交在-137，-136，-135，-133 的位置；2s 成交在-210，-209，-208 的位置；3s 成交在-316，-315，-314.5，-312.5 的位置；

中长期限，6s 成交在-630，-629，-628，-626 附近；9s 成交在-921，-920，-919，-918 附近；1Y 成交在-1192，-1191，-1190，-1189，-1188 的位置；

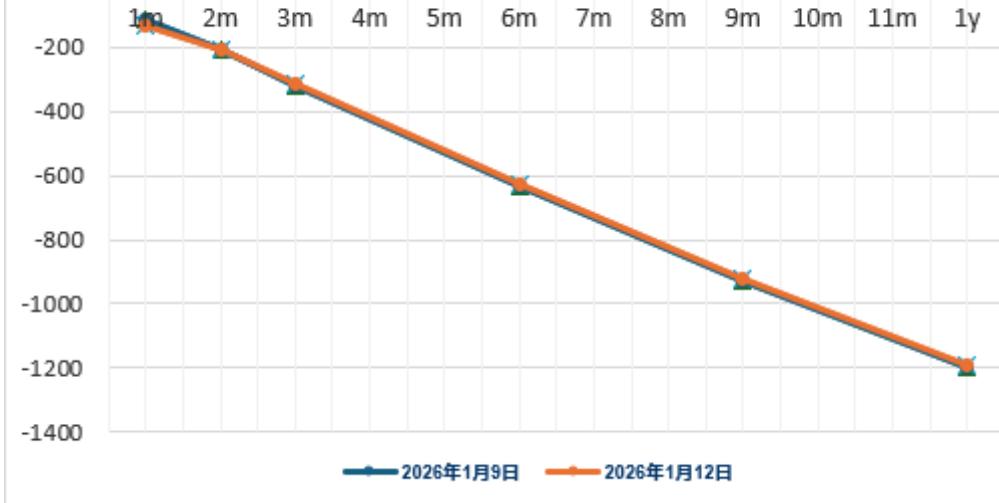
Spread 上，2w*3w 成交在-22.5 的位置 5s*6s 成交在-98 的位置；6s*1y 成交在-560 的位置；

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-25	6.9717	2.45
2W	14	-52	6.9690	3
1M	41	-133	6.9609	-19.42
2M	61	-208	6.9534	2
3M	90	-313	6.9429	9.2
6M	181	-628	6.9114	9
9M	273	-920	6.8822	8
1Y	365	-1191	6.8551	5
18M	546	-1675	6.8067	20
2Y	730	-2185	6.7557	12
3Y	1098	-3200	6.6542	25
CNY CENTRAL PARITY RATE		7.0108		
CLOSING SPOT RATE		6.9742		

USD/CNY Spread Ref.

	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-74.6	-179.6	-494.6	-786.6	-1057.6
2M		-105	-420	-712	-983
3M			-315	-607	-878
6M				-292	-563
9M					-271

Fx Swap Curve



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。