

常规报告系列

# 收盘日评 银行间外汇衍生品市场



【2026-02-06】

今日 Fixing 定在 6.9590，较上一交易下调了 20 个 bp。今日各期限收盘价较上一交易日有所上升。

短端，O/N 主要成交在-14~-13.5。T/N 主要成交在-4.46~-4.2 的位置。S/N 主要成交在-4.4~-4.35 的位置。2w 成交在-55 和-55.3 的位置。3w 成交在-87.4，-87 等位置。1s 成交在-112.7，-112.6，-112.5 等位置。2s 成交在-229.5，-230 等位置。3s 成交在-349，-347 等位置。

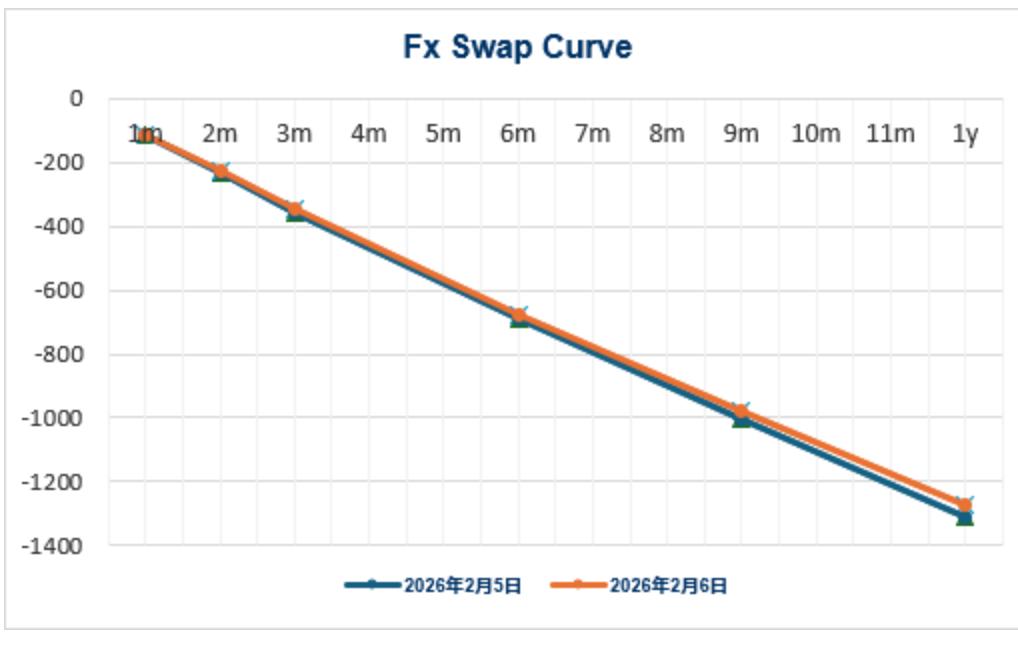
中长期限，5s 成交在-564 和-567 等位置。6s 成交在-675，-674 等位置。9s 成交在-976，-973，-972 等位置。1y 成交在-1270，-1272，-1267 等位置。

Spread 方面，1\*2s 成交在-117.5。6\*9s 成交在-299，9\*12s 成交在-297 的位置。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	15	-55	6.9346	4.85
2W	15	-55	6.9346	5
1M	28	-113	6.9289	1.5
2M	59	-230	6.9171	3
3M	91	-349	6.9052	7
6M	182	-677	6.8724	15
9M	273	-976	6.8425	25
1Y	372	-1273	6.8128	36
18M	546	-1785	6.7616	45
2Y	730	-2325	6.7076	75
3Y	1096	-3450	6.5951	100
CNY CENTRAL PARITY RATE		6.9590		
CLOSING SPOT RATE		6.9401		

## USD/CNY Spread Ref.

	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-117.5	-236.5	-564.5	-863.5	-1160.5
2M		-119	-447	-746	-1043
3M			-328	-627	-924
6M				-299	-596
9M					-297



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。