



【2026-09-04】

今日美元/人民币中间价报 6.7787，较上一个交易日下调 20bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

ON 从-16.8 买到过-16.5、-16.4、-16、-15.99；今日无 TN；SN 从-4.46 买到-4.35。1S 成交在-137；3S 成交在-424.2~-424 之间。

中长期限，9S 成交在-1339~-1338 之间；1Y 成交在-1824 附近。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-31	6.7077	0.44
2W	14	-63	6.7046	0
1M	30	-136	6.6972	2.4
2M	62	-287	6.6821	2
3M	91	-424	6.6684	2.8
6M	181	-869	6.6240	8
9M	273	-1339	6.5770	13.5
1Y	365	-1823	6.5285	17
18M	547	-2770	6.4338	30
2Y	731	-3700	6.3408	30
3Y	1098	-5510	6.1598	20
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7787	
CLOSING SPOT RATE			6.7108	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-151	-288.2	-732.5	-1202.5	-1687
2M		-137.2	-581.5	-1051.5	-1536
3M			-444.3	-914.3	-1398.8
6M				-470	-954.5
9M					-484.5



