



【2026-08-17】

今日美元/人民币中间价报 6.7873，较上一个交易日下调 5bp，全天掉期市场较为活跃。

O/N 成交在-4.6~-4.1； T/N 成交在-4.69~-4.61； S/N 成交在-4.66~-4.64； 2w 成交-65.5； 1s 成交在-152.8， -152.9； 3s 成交在-434。

中长期限， 6s 成交在-880.5； 1y 成交在-1774。

Spread 方面， 1s*2s 成交在-133， -133.1； 5s*6s 成交在-152， 6s*18s 成交在-1807。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-33	6.7349	-0.3
2W	14	-66	6.7317	-1
1M	33	-153	6.7229	-9.7
2M	61	-286	6.7096	4
3M	92	-434	6.6948	-0.5
6M	184	-881	6.6502	1
9M	273	-1317	6.6066	3.5
1Y	365	-1774	6.5608	3
18M	552	-2690	6.4692	-10
2Y	733	-3570	6.3812	0
3Y	1097	-5270	6.2112	5
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.7873	
CLOSING SPOT RATE			6.7382	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-132.7	-280.7	-727.2	-1163.2	-1620.58
2M		-148	-594.5	-1030.5	-1487.88
3M			-446.5	-882.5	-1339.88
6M				-436	-893.38
9M					-457.38



