

# 收盘日评 银行间外汇衍生品市场

常规报告系列



**NEX** 上海国际货币经纪  
Shanghai CFETS-NEX International Money Broking

【2026-04-01】

今日美元/人民币中间价报 6.9025，较上一个交易日下调 169bp，各期限收盘价较上一交易日上行。

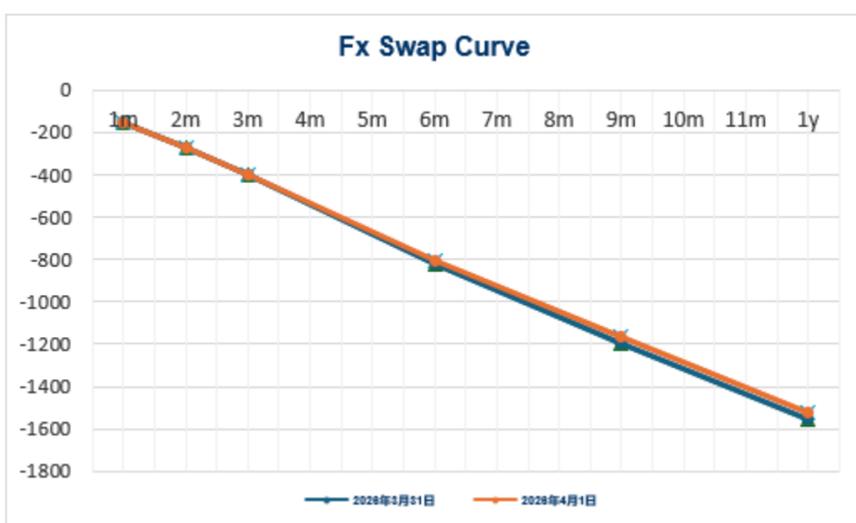
ON 从-4.66 买到-4.5，后一路给到-4.8、-5.5；TN 从-4.77 一路给到-6.66，后买回-6；SN 从-19.5 给到过-19.55、-19.6、-19.7。1W 成交在-33.5、-33.7、-33.8。1S 从-148.9 给到-150.4，后买回-149.5；3S 成交在-403。

中长期，6S 成交在-809~-807 之间；9S 成交在-1167；1Y 成交在-1535~-1525。

Spread 方面，3\*6S 成交在-407~-404，6\*12S 成交在-730。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-34	6.8706	-0.91
2W	14	-66	6.8674	-1
1M	33	-150	6.8590	3.01
2M	61	-274	6.8466	-3
3M	91	-404	6.8337	-1
6M	188	-807	6.7933	15
9M	276	-1165	6.7575	29
1Y	368	-1526	6.7214	32
18M	553	-2240	6.6500	110
2Y	731	0	6.5830	130
3Y	1096	-4300	6.4440	150
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9025	
CLOSING SPOT RATE			6.8740	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-123.96	-253.46	-656.96	-1014.96	-1375.96
2M		-129.5	-533	-891	-1252
3M			-403.5	-761.5	-1122.5
6M				-358	-719
9M					-361



免责声明：本日报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、发表或引用日报内容。日报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报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。