

# 收盘日评 银行间外汇远掉市场

常规报告系列



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

**【2023-02-28】**

今日美元/人民币中间价报 69519，较上一个交易日下调 53bp，各期限收盘价较上一交易日下行。

ON 成交在-5.2~-4.9 之间；TN 从-4.8 一路给到-5.1，后买回-4.93，尾盘收在-5.06 附近；SN 成交在-5.04~-4.87 之间。1W 成交在-34.5~-34.3 之间；2W 成交在-68.5~-68 之间；3W 成交在-101 附近。1S 在-152~-151 之间来回成交；2S 成交在-310~-308 之间；3S 成交在-465~-464 之间。

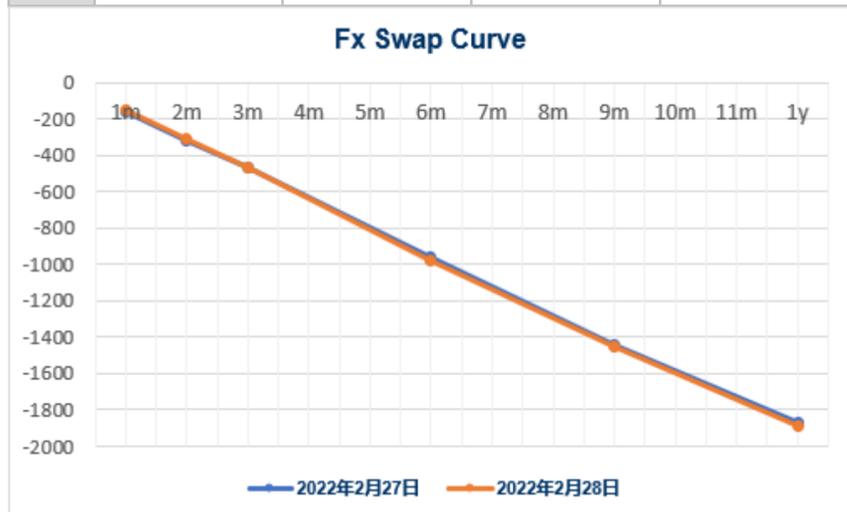
中长期，6S 从-965 给到-972；9S 在-1455~-1440 之间来回成交，尾盘收在-1455；1Y 从-1870 一路给到-1882，尾盘收在-1882。

超长期限，2Y 成交在-2730。

Spread 方面，3W\*1S 成交在-51、-51.5，3\*6S 成交在-506，6\*9S 成交在-478，9\*12S 成交在-427。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-34	6.9358	0.15
2W	14	-68	6.9324	0
1M	32	-152	6.9240	5.6
2M	63	-309	6.9084	7
3M	92	-465	6.8928	0.5
6M	187	-980	6.8412	-15
9M	277	-1457	6.7935	-10
1Y	368	-1885	6.7507	-12
18M	551	-2470	6.6922	30
2Y	732	-2750	6.6642	50
3Y	1096	-2966	6.6426	22
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9519	
CLOSING SPOT RATE			6.9392	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-156.6	-312.6	-828.1	-1305.1	-1733.1
2M		-156	-671.5	-1148.5	-1576.5
3M			-515.5	-992.5	-1420.5
6M				-477	-905
9M					-428



文 / Cathy He

联系人: Rafael Wang  
邮箱: rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所提及的所有信息(以下简称“信息”)仅用以提供信息,且为保密的和/或者专用的信息,其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司(以下简称“上海国际货币”)或第三方。“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。“信息”不可作为决策依据,也不保证其完整性、时效性或准确性等要求,且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

[WWW.CFETS-NEX.COM.CN](http://WWW.CFETS-NEX.COM.CN)