

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

【2026-02-27】

今日美元/人民币中间价报 6.9228，与上一日持平，各期限收盘价较上一交易日上行。

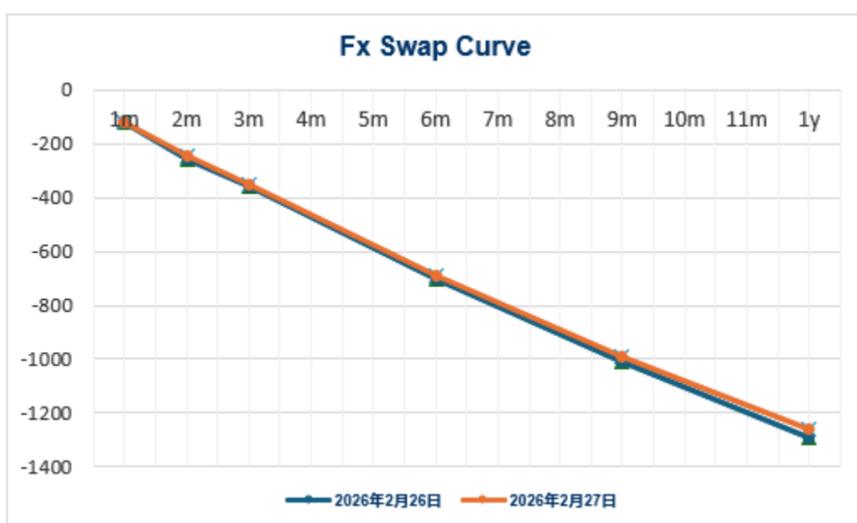
ON 成交-12~-10.5 区间；TN 成交-4.03，-4.02；SN 成交在-4.07~-4.03。1W 成交-28.6 和-28.4；2W 成交-57.5，-57。1S 成交-119.5 位置；2S 成交在-250 和-248 位置；3S 成交-353，-352.5。

中长期限，6S 成交-690，-686,9s 成交-996，-995，-986,1Y 成交-1245，-1260，-1262。

Spread 方面，9s*1y 成交-272,6s*1y 成交-571。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-28	6.8531	0.85
2W	14	-56	6.8503	2
1M	31	-120	6.8439	3.1
2M	64	-245	6.8314	11
3M	92	-355	6.8204	6
6M	184	-690	6.7869	12
9M	275	-990	6.7569	20
1Y	365	-1258	6.7301	31
18M	549	-1770	6.6789	50
2Y	731	-2280	6.6279	65
3Y	1098	-3300	6.5259	140
CNY CENTRAL PARITY RATE			6.9228	
CLOSING SPOT RATE			6.8559	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-125.4	-235.1	-570.1	-870.1	-1138.1
2M		-109.7	-444.7	-744.7	-1012.7
3M			-335	-635	-903
6M				-300	-568
9M					-268



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。