

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年3月15日-3月19日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周五（3月19日）报6.5098，较前周贬值约0.39%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.01%，上周最高6.4894、最低6.5185，收于6.5045，波幅为0.45%。上周境内人民币汇率小幅贬值，主要受近期美债收益率明显上行、美元指数上涨等因素影响。预计本周人民币汇率宽幅震荡，主要受美联储表态偏向鸽派、美债收益率持续攀升、市场关注中美战略对话等因素影响，预期人民币汇率将在6.4800-6.5800区间震荡。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点区间震荡，截至上周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行20个点，上周最高1817、最低1730，收于1770，波幅为4.92%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行153个点，上周最高6.7071，最低6.6513，收于6.6908，波幅为0.83%。

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，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。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较上月 末(点)	较去年 末(点)
即期汇率						
中间价	—	—	6.5098	253	385	-151
银行间市场汇价	6.4894	6.5185	6.5045	9	455	-353
掉期点						
1个月期限	187	163	166	-2	7	36
2个月期限	325	296	325	0	11	53
3个月期限	488	460	460	-11	3	75
6个月期限	932	445	908	9	30	168
1年期限	1817	1730	1770	20	71	339

数据来源：路透

表 2：境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较去年末 (点)	与境内价 差(点)
1个月期限	6.5504	6.4936	6.5231	105	-31	-31.5
2个月期限	6.5634	6.5121	6.5390	74	8	-32
3个月期限	6.5797	6.5290	6.5550	87	38	128
6个月期限	6.6191	6.5733	6.6036	177	166	479
1年期限	6.7071	6.6513	6.6908	153	316	41

数据来源：路透

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，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。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。