

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年2月22日-2月26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（2月26日）报6.4713，较前周贬值约0.14%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.02%，上周最高6.4451、最低6.4890，收于6.4590，波幅为0.68%。上周境内人民币汇率整体贬值，受近期美债收益率明显上行、中美利差有所收窄等因素影响。预计本周人民币汇率维持宽幅震荡走势，整体在6.4500~6.5300区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点呈现宽幅震荡，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下行19个点，上周最高1740、最低398.5，收于1699，波幅为78.96%。
- 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213个点，上周最高6.6842、最低6.6070，收于6.6502，波幅为1.16%。

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	—	—	6.4713	89	4	-536
银行间市场汇价	6.4890	6.4451	6.4590	15	-22	-808
掉期点						
1 个月期限	168.54	137	159	12	-20.5	29
2 个月期限	326	313	314	0	-10.5	42
3 个月期限	484.5	143	457	-12	-6.5	72
6 个月期限	925	855	878	-16.5	48	138
1 年期限	1740	398.5	1699	-19	109	268

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	6.5195	6.4563	6.4947	203	-315	198
2 个月期限	6.5405	6.4689	6.5112	241	-270	208
3 个月期限	6.5525	6.4814	6.5242	211	-270	195
6 个月期限	6.5965	6.5248	6.5682	225	-188	214
1 年期限	6.6842	6.6070	6.6502	213	-90	213

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。