

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年3月8日-3月12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12日）报6.4845，较前周升值约0.09%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.41%，上周最高6.4728、最低6.5445，收于6.5036，波幅为1.10%。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、中美利差有所收窄等因素影响。预计本周人民币汇率宽幅震荡，受美国通过1.9万亿美元纾困法案、美债收益率维持近期高位、结售汇市场供求均衡以及境内外股票市场波动较大等因素综合影响，预期人民币汇率将在6.4500-6.5600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87个点，上周最高1750、最低1676，收于1750，波幅为4.23%。
- 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）较前周下行103个点，上周最高6.7358、最低6.6324，收于6.6755，波幅为1.55%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	-	-	6.4845	-59	132	-404
银行间市场汇价	6.4728	6.5445	6.5036	268	446	-362
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	175	148	168	19	9	38
2 个月期限	325	296	325	24.5	11	53
3 个月期限	480	435	471	30	14	86
6 个月期限	905	858	899	41	21	159
1 年期限	1750	1676	1750	87	51	319

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	6.5927	6.4734	6.5126	-157	-136	-90
2 个月期限	6.5903	6.5014	6.5316	-127	-66	-57
3 个月期限	6.6060	6.5161	6.5463	-120	-49	90
6 个月期限	6.6503	6.5490	6.5859	-154	-11	340
1 年期限	6.7358	6.6324	6.6755	-103	163	-32

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。