

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年3月22日-3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（3月26日）报6.5376，较前周贬值约0.43%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.55%，上周最高6.5049、最低6.5475，收于6.5407，波幅为0.65%。上周境内人民币汇率震荡贬值，主要受近期美债收益率高位运行、美元指数上涨等因素影响。预计本周人民币汇率宽幅震荡，主要受中美国债利差高位回落、结售汇市场供求较为均衡等因素影响，预期人民币汇率将在6.5100-6.6000区间震荡。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡下行，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34个点，上周最高1764、最低1710，收于1736，波幅为3.11%。
- 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290个点，上周最高6.7398、最低6.6701，收于6.7198，波幅为1.04%。

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	—	—	6.5376	278	663	127
银行间市场汇价	6.5475	6.5049	6.5407	362	817	9
掉期点						
1个月期限	168	150.22	154	-12	-5	24
2个月期限	320	287	295	-30	-19	23
3个月期限	470	436.50	451	-9	-6	66
6个月期限	910	446	891	-17	13	151
1年期限	1764	1710	1736	-34	37	305

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	6.5748	6.5106	6.5540	309	278	-21
2个月期限	6.5905	6.5284	6.5693	303	311	-9
3个月期限	6.6070	6.5416	6.5853	303	341	-5
6个月期限	6.6513	6.5892	6.6350	314	480	52
1年期限	6.7398	6.6701	6.7198	290	606	55

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。