

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2023 年 3 月 13 日-3 月 17 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 17 日）报 6.9052，较前周升值约 0.87%。截至上周五 16:30，银行间市场人民币汇率较前周升值约 1.29%，上周最高 6.8345、最低 6.9196，收于 6.8765，波幅为 1.24%。
- 人民币外汇掉期市场：截至上周五 16:30，1 年期掉期点较前周上行 360 个点，上周最高-2、最低-1890，收于-1700，波幅为 111.09%。
- 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 222 个点，上周最高 6.7819、最低 6.6724，收于 6.7321，波幅为 1.63%。

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	—	—	6.9052	-603	-467	-594
银行间市场汇价	6.9196	6.8345	6.8765	-888	-627	-749
掉期点						
1 个月期限	-163	-194	-174	3	-22	-15
2 个月期限	-324	-369	-350	28	-47	-21
3 个月期限	-473	-555	-522	3	-58	-15
6 个月期限	0	-1035	-985	112	-2	55
1 年期限	-2	-1890	-1700	360	185	280

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	6.9133	6.8039	6.8668	-434	-309	77
2 个月期限	6.8998	6.7940	6.8523	-444	-314	108
3 个月期限	6.8760	6.7810	6.8393	-435	-309	150
6 个月期限	6.8735	6.7386	6.8018	-389	-274	238
1 年期限	6.7819	6.6724	6.7321	-222	-266	256

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。