

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年3月29日-4月2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（4月2日）报6.5649，较前周贬值约0.42%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.31%，上周最高6.5410、最低6.5799，收于6.5612，波幅0.59%。上周境内人民币汇率震荡贬值，主要受中美利差有所收窄、美元指数短期走强等因素影响。预计本周人民币汇率继续区间震荡，主要受结售汇市场供求较为均衡、投资者汇率预期发散等因素影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.5300-6.6000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点小幅震荡，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10个点，上周最高1764、最低1710，收于1730，波幅3.12%。
- 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364个点，上周最高6.7738、最低6.7086，收于6.7585，波幅0.96%。

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	—	—	6.5649	273	-64	400
银行间市场汇价	6.5799	6.5410	6.5612	205	94	214
掉期点						
1 个月期限	177.34	141.50	153.50	-0.50	-12.50	23.50
2 个月期限	310	286	305.50	10.50	9.50	33.50
3 个月期限	456	438.50	449	0	6.50	64
6 个月期限	921	0	896	5	-10	156
1 年期限	1764	1710	1730	-10	-5	299

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	6.6121	6.5478	6.5857	317	595	91.50
2 个月期限	6.6252	6.5633	6.6037	344	655	119.50
3 个月期限	6.6416	6.5812	6.6197	344	685	136
6 个月期限	6.6816	6.6285	6.6702	352	832	194
1 年期限	6.7738	6.7086	6.7585	364	993	243

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。