

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年4月6日-4月9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9日）报6.5409，较前周升值约0.37%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.04%，上周最高6.5361、最低6.5617，收于6.5589，波幅0.39%。上周境内人民币汇率小幅升值，主要受中美利差逐步企稳、鲍威尔讲话打消政策收紧顾虑、美元指数短期走弱等因素影响。预计本周人民币汇率继续区间震荡，主要受美联储强调延续宽松政策基调、我国结售汇市场供求相对均衡等因素影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.5400-6.6000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，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32个点，上周最高1745、最低417，收于1698，波幅78.21%。
- 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245个点，上周最高6.7664、最低6.7046，收于6.7340，波幅0.92%。

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	—	—	6.5409	-240	-304	160
银行间市场汇价	6.5617	6.5361	6.5589	-23	71	191
掉期点						
1 个月期限	161	82.50	141	-12.50	-25	11
2 个月期限	305	288	296	-9.50	0	24
3 个月期限	454.40	428.50	430	-19	-12.50	45
6 个月期限	908	-1.44	874	-22	-32	134
1 年期限	1745	417	1698	-32	-37	267

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	6.6002	6.5394	6.5659	-198	397	-71
2 个月期限	6.6133	6.5561	6.5832	-205	450	-53
3 个月期限	6.6299	6.5606	6.5987	-210	475	-32
6 个月期限	6.6779	6.6154	6.6469	-233	599	6
1 年期限	6.7664	6.7046	6.7340	-245	748	53

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。