

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年4月12日-4月16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16日）报6.5288，较前周升值约0.19%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.55%，上周最高6.5201、最低6.5604，收于6.5228，波幅0.62%。上周境内人民币汇率震荡升值，主要受美债收益率明显回落、美元指数下跌等因素影响。预计本周人民币汇率维持区间震荡，主要受美债收益率回落、市场供求相对均衡以及市场预期发散等因素综合影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.5200-6.6000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投相对活跃，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下行27个点，上周最高1722、最低1659，收于1671，波幅3.77%。
- 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234个点，上周最高6.7496、最低6.6844，收于6.7106，波幅0.97%。

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	—	—	6.5288	-121	-425	39
银行间市场汇价	6.5604	6.5201	6.5228	-361	-290	-170
掉期点						
1 个月期限	153	141.50	146	5	-20	16
2 个月期限	311	285	294	-2	-2	22
3 个月期限	447	427	432	2	-10.50	47
6 个月期限	887	840	852	-22	-54	112
1 年期限	1722	1659	1671	-27	-64	240

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	6.5914	6.5227	6.5421	-238	159	-71
2 个月期限	6.6051	6.5395	6.5596	-236	214	-53
3 个月期限	6.6208	6.5565	6.5751	-236	239	-32
6 个月期限	6.6601	6.5968	6.6223	-246	353	6
1 年期限	6.7496	6.6844	6.7106	-234	514	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。