

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年9月13日-9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（9月17日）报6.4527，较前周升值约0.06%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.18%，上周最高6.4297、最低6.4698，收于6.4521，波幅为0.62%。上周受美国零售数据表现良好、市场对美联储较早紧缩的预期重燃等因素影响，人民币对美元震荡贬值。预计人民币汇率维持区间震荡格局，受美国债务上限问题短期内难以有效解决、美联储缩减购债信号仍不确定、结售汇市场供求总体均衡等因素影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.4300~6.5000区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点区间震荡，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3个点，上周最高1843、最低1740，收于1742，波幅为5.91%。
- 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143个点，上周最高6.6454、最低6.5955，收于6.6119，波幅为0.75%。

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	—	—	6.4527	-39	-152	-722
银行间市场汇价	6.4297	6.4698	6.4521	113	-124	-877
掉期点						
1 个月期限	240	187	199	-5	-7	69
2 个月期限	392	330	337	-23	14	65
3 个月期限	540	471	480	-18	40	95
6 个月期限	1020	940	942	-8	83	202
1 年期限	1843	1740	1742	-3	123	311

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	6.4953	6.4364	6.4489	-133	-773	-231
2 个月期限	6.5073	6.4529	6.4654	-128	-728	-204
3 个月期限	6.5239	6.4679	6.4804	-133	-708	-197
6 个月期限	6.5638	6.5117	6.5279	-133	-591	-184
1 年期限	6.6454	6.5955	6.6119	-143	-473	-144

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。