

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年4月19日-4月23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23日）报6.4934，较前周升值约0.55%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.45%，上周最高6.4820、最低6.5319，收于6.4936，波幅0.77%。上周境内人民币汇率震荡升值，主要受美国长期国债收益率显著回调、中国经济稳步复苏等因素影响。预计本周人民币汇率维持区间震荡，主要受美国长期国债收益率显著回调等因素影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.4700-6.5500。
- 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33个点，上周最高1678、最低1606，收于1638，波幅4.40%。
- 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436个点，上周最高6.7156、最低6.6407，收于6.6670，波幅1.12%。

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	—	—	6.4934	-354	-779	-315
银行间市场汇价	6.5319	6.4820	6.4936	-292	-582	-462
掉期点						
1 个月期限	148	130	134	-12	-32	4
2 个月期限	286	261	274	-20	-22	2
3 个月期限	433	400	408	-24	-34.5	23
6 个月期限	852	810	818	-34	-88	78
1 年期限	1678	1606	1638	-33	-97	207

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	6.5618	6.4828	6.5024	-397	-238	-46
2 个月期限	6.5767	6.4988	6.5189	-407	-193	-21
3 个月期限	6.5932	6.5128	6.5339	-412	-173	-5
6 个月期限	6.6317	6.5585	6.5794	-429	-76	40
1 年期限	6.7156	6.6407	6.6670	-436	78	96

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。