

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年9月22日-9月24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24日）报6.4599，较前周贬值约0.11%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.19%，上周最高6.4529、最低6.4737，收于6.4645，波幅为0.32%。上周受中美紧张局势有所缓和、中美利差小幅扩大等因素共同影响，人民币对美元区间震荡。预计人民币汇率区间波动，受美联储可能最早11月启动缩减QE进程、中美十年期国债利差仍保持在相对高位等因素影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.4400~6.5100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26个点，上周最高1776、最低1711，收于1716，波幅为3.61%。
- 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161个点，上周最高6.6719、最低6.6216，收于6.628，波幅为0.76%。

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 | - | - | 6.4599 | 72 | -80 | -650 |
| 银行间市场汇价 | 6.4529 | 6.4737 | 6.4645 | 124 | 0 | -753 |
| 掉期点 | | | | | | |
| 1 个月期限 | 191.9 | 166 | 171.5 | -27.5 | -34.5 | 41.5 |
| 2 个月期限 | 341 | 316 | 321 | -16 | -2 | 49 |
| 3 个月期限 | 479 | 446.5 | 464 | -16 | 24 | 79 |
| 6 个月期限 | 954 | 912 | 916 | -26 | 57 | 176 |
| 1 年期限 | 1775 | 1713 | 1716 | -26 | 97 | 285 |

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 | 6.5115 | 6.4611 | 6.4773 | 284 | -489 | -43.5 |
| 2 个月期限 | 6.5275 | 6.4781 | 6.4843 | 189 | -539 | -123 |
| 3 个月期限 | 6.5425 | 6.4936 | 6.4992 | 188 | -520 | -117 |
| 6 个月期限 | 6.5905 | 6.5376 | 6.5422 | 143 | -448 | -139 |
| 1 年期限 | 6.6719 | 6.6216 | 6.6280 | 161 | -312 | -81 |

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。