

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年9月27日-10月8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（10月8日）报6.4604，较9月24日贬值约0.01%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较9月24日升值约0.24%，最高6.4389、最低6.4800，收于6.4491，波幅为0.64%。受中美紧张局势有所缓和、中美利差有所收窄等因素影响，人民币对美元区间震荡。预计人民币汇率区间波动，受美中美代表瑞士会晤提振中美关系边际改善预期、美国经济数据好坏不一等因素影响，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9月24日上行22个点，最高1739、最低1674，收于1738，波幅为3.74%。
- 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9月24日上行7个点，最高6.6590、最低6.6125，收于6.6287，波幅为0.70%。

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 9 月 24 日 (点)	较上月末 (点)	较去年末 (点)
即期汇率						
中间价	-	-	6.4604	5	-250	-645
银行间市场汇价	6.4389	6.4800	6.4491	-154	-135	-907
掉期点						
1 个月期限	160	127	159	-12.5	159	29
2 个月期限	335	129	298	-23	169	26
3 个月期限	472	439.5	470	6	19.5	85
6 个月期限	913	867	913	-3	32.5	173
1 年期限	1739	1674	1738	22	38	307

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 9 月 24 日 (点)	较去年末 (点)	与境内价差 (点)
1 个月期限	6.4855	6.4452	6.4612	-161	-650	-38
2 个月期限	6.5045	6.4644	6.4769	-74	-613	-20
3 个月期限	6.5210	6.4805	6.4929	-63	-583	-32
6 个月期限	6.5690	6.5227	6.5402	-20	-468	-2
1 年期限	6.6590	6.6125	6.6287	7	-305	58

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。