

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年10月11日-10月15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15日）报 6.4386，较前周升值约 0.34%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.20%，上周最高 6.4259、最低 6.4609，收于 6.4360，波幅为 0.54%。上周受美国非农数据不及预期、美联储 Taper 预期影响逐渐消化等因素影响，人民币对美元有所升值。预计人民币汇率宽幅波动，受我国进出口贸易顺差维持较高水平、美联储可能退出超宽松货币政策等因素影响，预计在岸人民币对美元汇率将在 6.4100~6.4700 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 6 个点，上周最高 1781、最低 1668，收于 1732，波幅为 6.52%。
- 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 33 个点，上周最高 6.6553、最低 6.5993，收于 6.6254，波幅为 0.85%。

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	-	-	6.4386	-218	-468	-863
银行间市场汇价	6.4259	6.4609	6.4360	-131	-266	-1038
掉期点						
1 个月期限	183.5	150.5	157.5	-1.5	157.5	27.5
2 个月期限	317	280	299	1	170	27
3 个月期限	500	472	481	11	30.5	96
6 个月期限	947	915	923	10	42.5	183
1 年期限	1781	1668	1732	-6	32	301

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	6.4870	6.4293	6.4541	-71	-721	-43.5
2 个月期限	6.5009	6.4463	6.4712	-57	-670	-123
3 个月期限	6.5175	6.4633	6.4877	-52	-635	-117
6 个月期限	6.5647	6.3763	6.5355	-47	-515	-139
1 年期限	6.6553	6.5993	6.6254	-33	-338	-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。