

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年5月6日-5月7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（5月7日）报6.4678，较前周贬值约0.01%。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6.4308、最低6.4846，收于6.4589，波幅0.83%。上周境内人民币汇率震荡升值，主要受美联储维持宽松货币政策、我国外贸数据表现强劲等因素影响。预计本周人民币汇率维持区间波动格局，主要受结售汇市场供求总体均衡、中美利差保持相对稳定等因素影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.4200-6.4800。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，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51个点，上周最高1623、最低1575，收于1584，波幅3.03%。
- 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619个点，上周最高6.6723、最低6.5682，收于6.5896，波幅1.58%。

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	—	—	6.4678	6	6	-571
银行间市场汇价	6.4846	6.4308	6.4589	-127	-127	-809
掉期点						
1个月期限	134.50	127	131.50	-5	-5	1.50
2个月期限	277	267.50	268	-2	-2	-4
3个月期限	417	0	400	-18	-18	15
6个月期限	820	400	801	-22	-22	61
1年期限	1623	1575	1584	-51	-51	153

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	6.5140	6.4200	6.4336	-550	-926	-384.5
2个月期限	6.5268	6.4342	6.4481	-555	-901	-376
3个月期限	6.5433	6.4496	6.4641	-560	-871	-348
6个月期限	6.5880	6.4891	6.5083	-573	-787	-307
1年期限	6.6723	6.5682	6.5896	-619	-696	-277

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。