

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年1月18日-1月22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（1月22日）报6.4617，较前周升值约0.02%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.12%，上周最高6.4555、最低6.4957，收于6.4830，波幅为0.65%。上周境内人民币汇率区间震荡，主要受监管合理引导市场预期、南下资金流入港股等上下行因素共同影响等因素影响。预计本周人民币汇率维持区间波动，将在6.4600-6.5300区间震荡。
- 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上行19个点，上周最高1427、最低1325，收于1357，波幅为7.52%。
- 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）较前周上行242个点，上周最高6.6746、最低6.5815，收于6.6355，波幅为1.40%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	—	—	6.4617	-16	-632	-632
银行间市场汇价	6.4975	6.4555	6.4830	78	-568	-568
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	159	104	148	12.50	18	18
2 个月期限	275	250	256	9	-16	-16
3 个月期限	399	117	372	14	-13	-13
6 个月期限	730	690	712	37	-28	-28
1 年期限	1427	1325	1357	19	-74	-74

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	6.5335	6.4650	6.5065	126	-197	87
2 个月期限	6.5401	6.4765	6.5190	163	-192	104
3 个月期限	6.5566	6.4885	6.5310	166	-202	108
6 个月期限	6.5949	6.5204	6.5660	188	-210	118
1 年期限	6.6746	6.5815	6.6355	242	-237	168

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。