

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年5月10日-5月14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14日）报6.4525，较前周升值约0.24%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.33%，上周最高6.4100、最低6.4578，收于6.4375，波幅为0.74%。上周境内人民币汇率区间震荡，受美元指数小幅走升、我国外贸数据表现强劲等因素共同影响。预计本周人民币汇率维持区间震荡格局，整体在6.4200~6.4700区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点宽幅震荡，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13个点，上周最高1580、最低1533，收于1571，波幅为2.99%。
- 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133个点，上周最高6.6376、最低6.5544，收于6.6029，波幅为1.26%。

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	—	—	6.4525	-153	-147	-724
银行间市场汇价	6.4578	6.4100	6.4375	-214	-341	-1023
掉期点						
1 个月期限	143	71	132.5	1	-4	2.5
2 个月期限	284.5	255	271	3	1	-1
3 个月期限	406.7	0	399	-1	-19	14
6 个月期限	806	392	800	-1	-23	60
1 年期限	1580	1533	1571	-13	-64	140

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	6.4886	6.4100	6.4539	203	-723	-384.5
2 个月期限	6.5029	6.4220	6.4679	198	-703	-376
3 个月期限	6.5187	6.4381	6.4829	188	-683	-348
6 个月期限	6.5577	6.4746	6.5246	163	-624	-307
1 年期限	6.6376	6.5544	6.6029	133	-563	-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。