

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年5月17日-5月21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21日）报6.4300，较前周升值约0.35%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.05%，上周最高6.4188、最低6.4444，收于6.4345，波幅为0.40%。上周境内人民币汇率小幅升值，受美元指数区间弱势震荡、国内经济延续平稳复苏态势等因素共同影响。预计本周人民币汇率维持区间震荡格局，整体在6.4000~6.4600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9个点，上周最高1612、最低1562，收于1562，波幅为3.20%。
- 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45个点，上周最高6.6231、最低6.5710，收于6.5984，波幅为0.79%。

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	—	—	6.4300	-225	-372	-949
银行间市场汇价	6.4444	6.4188	6.4345	-30	-371	-1053
掉期点						
1 个月期限	148.5	129.5	130.5	-2	-6	0.5
2 个月期限	277	262	266	-5	-4	-6
3 个月期限	412	390	392	-7	-26	7
6 个月期限	823	690	791	-9	-32	51
1 年期限	1612	1562	1562	-9	-73	131

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	6.4761	6.4211	6.4489	-50	-773	13.5
2 个月期限	6.4883	6.4365	6.4634	-45	-748	23
3 个月期限	6.5044	6.4515	6.4779	-50	-733	42
6 个月期限	6.5433	6.4922	6.5196	-50	-674	60
1 年期限	6.6231	6.5710	6.5984	-45	-608	77

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。