

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年5月24日-5月28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28日）报6.3858，较前周升值约0.69%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约1.05%，上周最高6.4399、最低6.3619，收于6.3674，波幅为1.22%。上周境内人民币汇率有所升值，主要受国内经济延续平稳复苏态势、国内资产对境外投资者吸引力上升等因素共同影响。预计人民币汇率维持高位区间震荡格局，受监管层提示人民币汇率双边波动风险、市场预期阶段性分化等因素综合影响。预计人民币汇率将在6.3300~6.4000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，中长期方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周上行5个点，上周最高1580、最低1540，收于1567，波幅为2.55%。
- 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819个点，上周最高6.6154、最低6.4944，收于6.5165，波幅为1.86%。

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	—	—	6.3858	-442	-814	-1391
银行间市场汇价	6.4399	6.3619	6.3674	-671	-1042	-1724
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	143.1	8	130	-0.5	-6.5	0
2 个月期限	274.06	257	266	0	-4	-6
3 个月期限	400.5	0	388	-4	-30	3
6 个月期限	804.77	401	788	-3	-35	48
1 年期限	1580	1540	1567	5	-68	136

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	6.4684	6.3574	6.3730	-759	-1532	-74
2 个月期限	6.4813	6.3741	6.3765	-869	-1617	-175
3 个月期限	6.4985	6.3866	6.3990	-789	-1522	-72
6 个月期限	6.5378	6.4171	6.4380	-816	-1490	-82
1 年期限	6.6154	6.4944	6.5165	-819	-1427	-76

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。