

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年6月7日-6月11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（6月11日）报6.3856，较前周升值约0.34%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.28%，上周最高6.3800、最低6.4033，收于6.3914，波幅为0.36%。上周境内人民币汇率小幅升值，主要受我国外贸数据表现强劲、美国通胀数据高企加剧政策收紧担忧等因素影响。预计人民币汇率维持宽幅震荡格局，受美国通胀数据持续高增、银行间市场供求总体均衡等因素综合影响，预计人民币汇率将在6.3600~6.4400区间震荡。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投非常活跃，各期限掉期点震荡上行，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上行80个点，上周最高1580、最低1514，收于1580，波幅为4.18%。
- 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128个点，上周最高6.5816、最低6.5186，收于6.5336，波幅为0.96%。

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	—	—	6.3856	-216	174	-1393
银行间市场汇价	6.4033	6.3800	6.3914	-178	307	-1484
掉期点						
1 个月期限	130.5	123	126	6	-1	-4
2 个月期限	255	246	255	10	-12	-17
3 个月期限	391	370	386	22	6	1
6 个月期限	783	750	783	38	18	43
1 年期限	1580	1514	1580	80	50	149

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	6.4342	6.3798	6.4108	69	-1154	68
2 个月期限	6.4469	6.3934	6.4232	63	-1150	63
3 个月期限	6.4633	6.4062	6.4367	68	-1145	67
6 个月期限	6.5000	6.4399	6.4775	84	-1095	78
1 年期限	6.5816	6.5186	6.5336	-128	-1256	-158

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。