

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年11月15日-11月19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（11月19日）报6.3825，较前周升值约0.38%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.14%，上周最高6.3666、最低6.3969，收于6.3811，波幅为0.47%。上周受国内货币政策空间充足、美元指数震荡走强等因素影响，人民币对美元汇率小幅震荡。预计人民币汇率区间浮动，受我国银行结售汇市场持续保持顺差格局、近期美国经济数据好于预期等因素综合影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.3700-6.4200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34个点，上周最高1690、最低1653，收于1672，波幅为2.26%。
- 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149个点，上周最高6.5718、最低6.5235，收于6.5652，波幅为0.74%。

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	—	—	6.3825	-240	-82	-1424
银行间市场汇价	6.3666	6.3969	6.3811	-91	-198	-1587
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	139.7	126.5	129	2	-18	-1
2 个月期限	314	301	306.5	2.5	-33.5	34.5
3 个月期限	479	456	461.5	8.5	-66	76.5
6 个月期限	873	856	866	15	-64	126
1 年期限	1690	1653	1672	34	-55	241

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	6.4211	6.3695	6.4062	162	-1200	67
2 个月期限	6.4358	6.384	6.4222	174	-1160	49.5
3 个月期限	6.4529	6.3995	6.4382	159	-1130	209.5
6 个月期限	6.4887	6.442	6.4812	164	-1089	484.5
1 年期限	6.5718	6.5235	6.5652	149	-940	118

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。