

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年11月22日-11月26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26日）报6.3936，较前周贬值约0.17%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.19%，上周最高6.3755、最低6.3948，收于6.3930，波幅为0.30%。上周人民币对美元汇率小幅贬值，主要受美联储收紧货币政策预期抬升等因素影响。预计本周人民币汇率区间浮动，受企业年末季节性结汇、新型变异病毒引发市场恐慌等因素综合影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.3600-6.4100区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点区间震荡，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20个点，上周最高1672、最低1550，收于1652，波幅为7.30%。
- 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8个点，上周最高6.5740、最低6.5410，收于6.5644，波幅为0.50%。

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	—	—	6.3936	111	29	-1313
银行间市场汇价	6.3755	6.3948	6.3930	119	-79	-1468
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	147	127	142.5	13.5	-4.5	12.5
2 个月期限	309	288.47	304.5	-2	-35.5	32.5
3 个月期限	468.25	442.07	462	0.5	-65.5	77
6 个月期限	865.02	835	864	-2	-66	124
1 年期限	1672	1550	1652	-20	-75	221

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	6.4241	6.3836	6.4104	42	-1158	31.5
2 个月期限	6.4360	6.3996	6.4249	27	-1133	14.5
3 个月期限	6.4525	6.4156	6.4409	27	-1103	17
6 个月期限	6.4926	6.4566	6.4839	27	-1031	45
1 年期限	6.5740	6.5410	6.5644	-8	-948	62

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。