

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年5月31日-6月4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4日）报6.4072，较前周贬值约0.33%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.68%，上周最高6.3565、最低6.4133，收于6.4092，波幅为0.89%。上周境内人民币汇率有所贬值，主要受美国经济复苏、美元指数走强等因素影响。预计人民币汇率维持宽幅震荡格局，受美国通胀数据超出预期、市场对人民币汇率预期出现分化等因素综合影响，预计人民币汇率将在6.3500~6.4200区间震荡。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡下行，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下行67个点，上周最高1587、最低1483，收于1500，波幅为6.93%。
- 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299个点，上周最高6.5906、最低6.4984，收于6.5464，波幅为1.41%。

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	—	—	6.4072	214	390	-1177
银行间市场汇价	6.3565	6.4133	6.4092	438	485	-1306
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	139	0	120	-10	-7	-10
2 个月期限	269	240	245	-21	-22	-27
3 个月期限	405	0	364	-24	-16	-21
6 个月期限	854	365	745	-43	-20	5
1 年期限	1587	1483	1500	-67	-30	69

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	6.4426	6.3559	6.4039	309	-1223	-31
2 个月期限	6.4556	6.3689	6.4169	404	-1213	-26
3 个月期限	6.4721	6.3824	6.4299	309	-1213	-15
6 个月期限	6.5106	6.4214	6.4691	311	-1179	-4
1 年期限	6.5906	6.4984	6.5464	299	-1128	14

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。