

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年6月15日-6月18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18日）报 6.4361，较前周贬值约 0.78%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.77%，上周最高 6.3960、最低 6.4537，收于 6.4408，波幅为 0.90%。上周境内人民币汇率震荡贬值，主要受美联储议息会议调整政策表述、提前加息预期升温带动美元走强等因素影响。预计人民币汇率区间浮动，受 6 月美联储议息会议提高超额准备金利率和逆回购利率、调升经济增长和通胀展望等因素综合影响，预计人民币汇率将在 6.4000 ~ 6.4800 区间震荡。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，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 36 个点，上周最高 1640、最低 1558，收于 1616，波幅为 5.07%。
- 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 951 个点，上周最高 6.6350、最低 6.5384，收于 6.6287，波幅为 1.46%。

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	—	—	6.4361	505	679	-888
银行间市场汇价	6.4537	6.3960	6.4408	494	801	-990
掉期点						
1 个月期限	142	125	141	15	14	11
2 个月期限	275	254	274	19	7	2
3 个月期限	410	375	404	18	24	19
6 个月期限	814	772	808	25	43	68
1 年期限	1640	1558	1616	36	86	185

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	6.4810	6.3939	6.4767	659	-495	218
2 个月期限	6.4942	6.4067	6.4897	665	-485	215
3 个月期限	6.5106	6.4226	6.5062	695	-450	250
6 个月期限	6.5516	6.4564	6.5482	707	-388	266
1 年期限	6.6350	6.5384	6.6287	951	-305	263

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。