

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年6月21日-6月25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25日）报6.4744，较前周贬值约0.59%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.22%，上周最高6.4471、最低6.4901，收于6.4553，波幅0.67%。上周境内人民币汇率震荡贬值，主要受美联储部分官员表示宜早启动减码措施、市场交投相对谨慎等因素影响。预计本周人民币汇率维持区间窄幅波动格局，主要受美国基础设施支出计划达成初步协议、市场参与者保持观望态势等因素综合影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.4100-6.4900。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，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66个点，上周最高1608、最低1538.50，收于1550，波幅4.48%。
- 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25个点，上周最高6.6654、最低6.6033，收于6.6262，波幅0.94%。

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	—	—	6.4744	383	1062	-505
银行间市场汇价	6.4901	6.4471	6.4553	145	946	-845
掉期点						
1 个月期限	149.50	130	134.50	-6.50	7.50	4.50
2 个月期限	278	126	262.50	-11.50	-4.50	-9.50
3 个月期限	410	382	387	-17	7	2
6 个月期限	805	771	777	-31	12	37
1 年期限	1608	1538.50	1550	-66	20	119

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	6.5220	6.4532	6.4722	-45	-540	34.5
2 个月期限	6.5292	6.4687	6.4872	-25	-510	56.5
3 个月期限	6.5457	6.4822	6.5017	-45	-495	77
6 个月期限	6.5856	6.5228	6.5442	-40	-428	112
1 年期限	6.6654	6.6033	6.6262	-25	-330	159

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。