

# 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<br>(点) | 较上月<br>末(点) | 较去年<br>末(点) |
|-------------|--------|---------|--------|------------|-------------|-------------|
| <b>即期汇率</b> |        |         |        |            |             |             |
| 中间价         | —      | —       | 6.4744 | 383        | 1062        | -505        |
| 银行间市场汇价     | 6.4901 | 6.4471  | 6.4553 | 145        | 946         | -845        |
| <b>掉期点</b>  |        |         |        |            |             |             |
| 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<br>(点) | 较去年末<br>(点) | 与境内价<br>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。