

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年10月18日-10月22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（10月22日）报6.4032，较前周升值约0.55%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.72%，上周最高6.3794、最低6.4393，收于6.3903，波幅0.94%。上周境内人民币汇率有所升值，主要受海外资本买涨人民币意愿较强、美元指数回调等因素影响。预计本周人民币汇率区间波动，主要受我国经济总体保持恢复态势、美联储减码购债预期推升美债收益率等因素影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.3600-6.4300。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，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19个点，上周最高1775、最低1730，收于1751，波幅2.57%。
- 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559个点，上周最高6.6350、最低6.5424，收于6.5695，波幅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	—	—	6.4032	-354	-822	-1217
银行间市场汇价	6.4393	6.3794	6.3903	-457	-723	-1495
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	179.55	158	163	5.50	163	33
2 个月期限	316.50	297	311	13.80	182	39
3 个月期限	509.50	486.50	503	22	52.50	118
6 个月期限	953	907.86	941	19.50	60.50	201
1 年期限	1775	1730	1751	19	51	320

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	6.4700	6.3774	6.3992	-549	-1270	-43.5
2 个月期限	6.4815	6.3913	6.4150	-562	-1232	-123
3 个月期限	6.4995	6.4112	6.4332	-545	-1180	-117
6 个月期限	6.5460	6.4523	6.4787	-568	-1083	-139
1 年期限	6.6350	6.5424	6.5695	-559	-897	-81

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。