

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年11月1日-11月5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（11月5日）报6.3980，较前周贬值约0.11%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.01%，上周最高6.3910、最低6.4083，收于6.4013，波幅0.27%。上周境内人民币汇率窄幅震荡，主要受美联储启动缩减购债符合市场预期、中美利差小幅扩大以及美元指数走强等因素影响。预计本周人民币汇率区间波动，主要受市场对欧洲收紧货币政策预期有所减弱、我国外贸出口表现较好等因素影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.3700-6.4300。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点呈区间震荡走势。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28.5个点，上周最高1735.5、最低403.0，收于1698.5，波幅77.16%。
- 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）较前周下跌148个点，上周最

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。

高 6.5931、最低 6.5568，收于 6.5721，波幅 0.55%。

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	-	-	6.3980	73	73	-1269
银行间市场汇价	6.3910	6.4083	6.4013	4	4	-1385
掉期点						
1 个月期限	151.5	127	131.5	-15.5	-15.5	1.5
2 个月期限	375.33	70	318.5	-21.5	-21.5	46.5
3 个月期限	549.48	395	480.5	-47	-47	95.5
6 个月期限	932	795	890	-40	-40	150
1 年期限	1735.5	403	1698.5	-28.5	-28.5	267.5

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	6.4375	6.3945	6.4095	-112	-1167	-49.5
2 个月期限	6.4522	6.4093	6.4258	-111	-1124	-73.5
3 个月期限	6.4687	6.4290	6.4418	-144	-1094	-75.5
6 个月期限	6.5072	6.4705	6.4860	-147	-1010	-43
1 年期限	6.5931	6.5568	6.5721	-148	-871	9.5

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。