

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年11月8日-11月12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12日）报6.4065，较前周贬值约0.13%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.17%，上周最高6.3806、最低6.4114，收于6.3902，波幅为0.48%。上周受贸易及外汇储备数据稳中向好、外资配置需求旺盛等因素影响，人民币对美元汇率小幅升值。预计人民币汇率区间浮动，受我国进出口顺差保持记录高位、美国通胀数据高于预期等因素综合影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.3600-6.4100区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡下行，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60.5个点，上周最高1721、最低1638，收于1638，波幅为4.89%。
- 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218个点，上周最高6.5874、最低6.5350，收于6.5503，波幅为0.80%。

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	-	-	6.4065	85	158	-1184
银行间市场汇价	6.3806	6.4114	6.3902	-111	-107	-1496
掉期点						
1 个月期限	140	122	127	-4.5	-20	-3
2 个月期限	318	300	304	-14.5	-36	32
3 个月期限	502	451	453	-27.5	-74.5	68
6 个月期限	896.5	846	851	-39	-79	111
1 年期限	1721	1638	1638	-60.5	-89	207

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	6.4359	6.3805	6.3900	-195	-1362	-129
2 个月期限	6.4494	6.3965	6.4048	-210	-1334	-158
3 个月期限	6.4658	6.4115	6.4223	-195	-1289	-132
6 个月期限	6.5072	6.4540	6.4648	-212	-1222	-105
1 年期限	6.5874	6.5350	6.5503	-218	-1089	-37

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。