

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年10月25日-10月29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29日）报6.3907，较前周升值约0.20%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.17%，上周最高6.3782、最低6.4122，收于6.4009，波幅0.53%。上周境内人民币汇率小幅贬值，主要受市场供求整体均衡、美元指数有所上行等因素影响。预计本周人民币汇率区间波动，主要受我国外贸出口需求较旺盛、美联储可能在本周决定缩减购债等因素影响，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，掉期点区间震荡，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24个点，上周最高1750、最低1711，收于1727，波幅2.23%。
- 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）较前周上行174个点，上周最高6.5942、最低6.5425，收于6.5869，波幅0.78%。

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	—	—	6.3907	-125	-947	-1342
银行间市场汇价	6.4122	6.3782	6.4009	106	-617	-1389
掉期点						
1个月期限	170	138.65	147	-16	147	17
2个月期限	390.62	290	340	29	211	68
3个月期限	540	482	527.50	24.50	77	142.50
6个月期限	940	917	930	-11	49.50	190
1年期限	1750	1711	1727	-24	27	296

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	6.4347	6.3812	6.4207	215	-1055	51
2个月期限	6.4479	6.3957	6.4369	219	-1013	20
3个月期限	6.4649	6.4137	6.4562	230	-950	25.50
6个月期限	6.5072	6.4532	6.5007	220	-863	68
1年期限	6.5942	6.5425	6.5869	174	-723	133

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。