

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年7月19日-7月23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4日）报 6.4650，较前周升值约 0.09%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.13%，上周最高 6.4915、最低 6.4626，收于 6.4759，波幅为 0.45%。上周境内人民币汇率区间震荡，主要受中美利差收窄、我国经济保持较好上升势头等因素共同影响。预计人民币汇率维持区间波动态势，受境内债券市场吸引力持续增强、德尔塔变异病毒在境外蔓延导致避险情绪滋生等因素综合影响，预计人民币汇率将在 6.4500~6.5000 区间震荡。
- 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 44 个点，上周最高 1620、最低 1550，收于 1602，波幅为 4.37%。
- 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 92 个点，上周最高 6.6715、最低 6.6195，收于 6.6532，波幅为 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	—	—	6.465	-55	49	-599
银行间市场汇价	6.4915	6.4626	6.4759	81	181	-639
掉期点						
1 个月期限	151	137	141	3	6.3	11
2 个月期限	285.05	271	275	0	10	3
3 个月期限	453	0	434.5	13	5.5	49.5
6 个月期限	859	411	844	24	35	104
1 年期限	1620	1550	1602	44	28	171

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	6.5199	6.4664	6.4911	13	-351	11
2 个月期限	6.5357	6.4845	6.5081	19	-301	47
3 个月期限	6.5522	6.5005	6.5246	14	-266	52.5
6 个月期限	6.5910	6.5425	6.5701	43	-169	98
1 年期限	6.6715	6.6195	6.6532	92	-60	171

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。