

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021 年 7 月 26 日-7 月 30 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 6.4749，较前周升值约 0.07%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 0.31%，上周最高 6.5133、最低 6.4500，收于 6.4560，波幅为 0.98%。上周境内人民币汇率先贬后升，主要受境内市场情绪不佳、美元指数震荡下行等因素共同影响。预计人民币汇率维持区间波动态势，受境内市场情绪有望趋稳、欧美各国疫情重新抬头引发避险情绪升温等因素综合影响，预计人民币汇率将在 6.4400~6.5000 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上行 8 个点，上周最高 1700、最低 1600，收于 1610，波幅为 6.21%。
- 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 154 个点，上周最高 6.7091、最低 6.6186，收于 6.6378，波幅为 1.36%。

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	—	—	6.4602	-48	1	-647
银行间市场汇价	6.5133	6.4500	6.456	-199	-18	-838
掉期点						
1 个月期限	171.5	130	130	-11	-4.7	0
2 个月期限	365	275	311	36	46	39
3 个月期限	465.05	423	419	-15.5	-10	34
6 个月期限	910	827	875	31	66	135
1 年期限	1700	1600	1610	8	36	179

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	6.5436	6.4536	6.4896	-15	-366	206
2 个月期限	6.5611	6.4726	6.5026	-55	-356	155
3 个月期限	6.5791	6.4866	6.5172	-74	-340	193.0
6 个月期限	6.6291	6.5371	6.5575	-126	-295	140
1 年期限	6.7091	6.6186	6.6378	-154	-214	208

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。