

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年8月16日-8月20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（8月20日）报 6.4984，较前周贬值约 0.28%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.26%，上周最高 6.4733、最低 6.4987，收于 6.5000，波幅为 0.39%。上周境内人民币汇率震荡贬值，主要受中美利差小幅上涨、美元指数上涨等因素共同影响。预计人民币汇率维持区间波动态势，受 A 股调整导致避险情绪蔓延、美国经济数据喜忧参半等因素影响，预计人民币汇率将在 6.4700~6.5400 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 23 个点，上周最高 1605、最低 1500，收于 1582，波幅为 6.64%。
- 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 95 个点，上周最高 6.6889、最低 6.6390，收于 6.6725，波幅为 0.75%。

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	-	-	6.4984	185	382	-265
银行间市场汇价	6.4987	6.4733	6.5000	170	440	-398
掉期点						
1 个月期限	159	94.5	136.5	-0.5	4	6.5
2 个月期限	303.4	292	300	-3	-11	28
3 个月期限	433	423	425	-4	4	40
6 个月期限	870	827	846.5	-13.5	-28.5	106.5
1 年期限	1605	1500	1582	-23	-28	151

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	6.5356	6.4761	6.5095	123	-167	-41.5
2 个月期限	6.5493	6.4946	6.5263	123	-119	-37
3 个月期限	6.5657	6.5111	6.5417	112	-95	-8.0
6 个月期限	6.6059	6.5550	6.5890	105	20	43.5
1 年期限	6.6889	6.6390	6.6725	95	133	143

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。