

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年8月23日-8月27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27日）报6.4863，较前周升值约0.19%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.45%，上周最高6.4690、最低6.4968，收于6.4711，波幅为0.43%。上周境内人民币汇率明显升值，主要受市场供求整体均衡、美元指数冲高回落等因素影响。预计人民币汇率维持区间震荡走势，受欧美及东南亚疫情持续蔓延、杰克逊霍尔年会后美联储政策调整仍存不确定性等因素影响，预计人民币汇率将在6.4500~6.5300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27个点，上周最高1620、最低1591，收于1609，波幅为1.80%。
- 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381个点，上周最高6.6820、最低6.6186，收于6.6344，波幅为0.96%。

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	-	-	6.4863	-121	261	-386
银行间市场汇价	6.4968	6.4690	6.4711	-289	151	-687
掉期点						
1 个月期限	150	95	144	7.5	11.5	14
2 个月期限	309.5	292	305	5	-6	33
3 个月期限	444	423	437	12	16	52
6 个月期限	872	827	854	7.5	-21	114
1 年期限	1620	1591	1609	27	-1	178

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	6.5272	6.4626	6.4763	-332	-499	-92
2 个月期限	6.5409	6.4781	6.4862	-401	-520	-154
3 个月期限	6.5578	6.4945	6.5022	-395	-490	-126
6 个月期限	6.5995	6.5315	6.5522	-368	-348	-43
1 年期限	6.6820	6.6186	6.6344	-381	-248	24

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。