

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年8月30日-9月3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（9月3日）报6.4577，较前周升值约0.44%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.23%，上周最高6.4488、最低6.4731，收于6.4565，波幅0.38%。上周境内人民币汇率有所升值，主要受市场供求整体均衡、美元指数明显下行等因素影响。预计本周人民币汇率震荡偏强，主要受美联储收紧货币政策预期有所减弱、欧美疫情防控仍不确定等因素影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.4300-6.4800。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点呈窄幅震荡的走势。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58个点，上周最高1672、最低1589，收于1667，波幅4.98%。
- 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171个点，上周最高6.6551、最低6.5894，收于6.6173，波幅0.99%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	—	—	6.4577	-286	-102	-672
银行间市场汇价	6.4488	6.4731	6.4565	-146	-80	-833
<b>掉期点</b>						
1 个月期限	249	191.8	194.5	50.5	-11.5	64.5
2 个月期限	338	294	337	32	14	65
3 个月期限	468	423	465.5	28.5	25.5	80.5
6 个月期限	895.5	556	895	41	36	155
1 年期限	1672	1589	1667	58	48	236

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	6.5025	6.4356	6.4572	-191	-690	-187.5
2 个月期限	6.5140	6.4497	6.4705	-157	-677	-197
3 个月期限	6.5296	6.4660	6.4851	-171	-661	-179.5
6 个月期限	6.5716	6.5065	6.5326	-196	-544	-134
1 年期限	6.6551	6.5894	6.6173	-171	-419	-59

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。