

工行金融市场：人民币汇率市场本周概览

(2021年2月1日-2月5日)

◆ 人民币汇率市场本周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价本周五（2月5日）报6.4710，与上周基本持平。银行间外汇市场人民币对美元汇率较上周贬值约0.31%，本周最高6.4300、最低6.4823，收于6.4810，波幅为0.81%。本周境内人民币汇率整体贬值，主要受美元指数走强等因素影响。预计下周人民币汇率维持区间浮动态势，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，截至本周五16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较上周上行70个点，本周最高1676、最低1495，收于1660，波幅为10.90%。
- 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）较上周上行160个点，本周最高6.6606、最低6.5958，收于6.6211，波幅为0.98%。

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 | 较上周 (点) | 较上月 末(点) | 较去年 末(点) |
|-------------|--------|--------|--------|------------|-------------|-------------|
| 即期汇率 | | | | | | |
| 中间价 | — | — | 6.4710 | 1 | 1 | -539 |
| 银行间市场汇价 | 6.4823 | 6.4300 | 6.4810 | 198 | 198 | -588 |
| 掉期点 | | | | | | |
| 1个月期限 | 171 | 142 | 154 | -25.50 | -25.50 | 24 |
| 2个月期限 | 338 | 280 | 324.50 | 0 | 0 | 52.50 |
| 3个月期限 | 472.50 | 423 | 457 | -6.50 | -6.50 | 72 |
| 6个月期限 | 872.50 | 800 | 848 | 18 | 18 | 108 |
| 1年期限 | 1676 | 1495 | 1660 | 70 | 70 | 229 |

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 | 较上周 (点) | 较去年末 (点) | 与境内价 差(点) |
|-------|--------|--------|--------|------------|-------------|--------------|
| 1个月期限 | 6.5137 | 6.4550 | 6.4696 | 90 | -566 | -268 |
| 2个月期限 | 6.5256 | 6.4715 | 6.4851 | 85 | -531 | -283 |
| 3个月期限 | 6.5431 | 6.4860 | 6.5006 | 90 | -506 | -261 |
| 6个月期限 | 6.5802 | 6.5224 | 6.5416 | 155 | -454 | -242 |
| 1年期限 | 6.6606 | 6.5958 | 6.6211 | 160 | -381 | -259 |

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。