

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。