

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年6月28日-7月2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（7月2日）报6.4712，较前周升值约0.05%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.42%，上周最高6.4512、最低6.4855，收于6.4825，波幅0.53%。上周境内人民币汇率震荡贬值，主要受部分国家疫情重新恶化使得避险情绪升温推升美元指数、境内银行间外汇市场交投相对谨慎等因素影响。预计本周人民币汇率维持区间波动格局，主要受境内外汇市场供求整体较为均衡、部分国家疫情恶化削弱经济复苏预期、美联储货币政策延续宽松等因素综合影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.4400-6.5200。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点区间震荡，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16个点，上周最高1580、最低1552，收于1566，波幅1.79%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1年期境外美元对

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。

人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行 60 个点，上周最高 6.6639、最低 6.6073，收于 6.6322，波幅 0.85%。

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	—	—	6.4712	-32	111	-537
银行间市场汇价	6.4855	6.4512	6.4825	272	247	-573
掉期点						
1 个月期限	156	0	134	-0.50	-0.70	4
2 个月期限	285	0	271.50	9	6.50	-0.50
3 个月期限	460	388	427.50	40.50	-1.50	42.50
6 个月期限	825	785	815	38	6	75
1 年期限	1580	1552	1566	16	-8	135

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	6.5153	6.46	6.4797	75	-465	-162
2 个月期限	6.5286	6.4745	6.5025	153	-357	-71.5
3 个月期限	6.5447	6.4909	6.5164	147	-348	-88.5
6 个月期限	6.5838	6.5272	6.5508	66	-362	-132
1 年期限	6.6639	6.6073	6.6322	60	-270	-69

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。