

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年7月5日-7月9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9日）报6.4755，较前周贬值约0.07%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.03%，上周最高6.4918、最低6.4830，收于6.4847，波幅0.14%。上周境内人民币汇率小幅震荡，主要受人民银行宣布降准、美联储会议纪要整体符合市场预期、美元指数保持窄幅震荡等因素共同影响。预计本周人民币汇率维持区间波动格局，主要受央行全面降准、美联储内部对通胀和货币政策调整看法不一、境内外汇市场供求整体较为均衡等因素综合影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.4600-6.5400。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点宽幅震荡，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4个点，上周最高1615、最低1565，收于1570，波幅3.18%。
- 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 153 个点，上周最高 6.6701、最低 6.6117，收于 6.6475，波幅 0.88%。

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	—	—	6.4755	43	154	-494
银行间市场汇价	6.4830	6.4918	6.4847	22	269	-551
掉期点						
1 个月期限	146	131	139.5	5.5	4.8	9.5
2 个月期限	275	267	271	-0.5	6	-1
3 个月期限	453	420	425	-2.5	-4	40
6 个月期限	848	823	831	16	22	91
1 年期限	1615	1565	1570	4	-4	139

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	6.5230	6.4602	6.4930	133	-332	-56.5
2 个月期限	6.5348	6.4752	6.5085	60	-297	-33
3 个月期限	6.5526	6.4902	6.5245	81	-267	-27
6 个月期限	6.5901	6.5337	6.5670	162	-200	-8
1 年期限	6.6701	6.6117	6.6475	153	-117	58

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。