

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年7月12日-7月16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16日）报6.4705，较前周升值约0.08%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.26%，上周最高6.4480、最低6.4798，收于6.4678，波幅0.49%。上周境内人民币汇率小幅升值，主要受人民银行宣布降准、美联储主席鲍威尔鸽派表态、我国二季度经济数据保持稳健等因素共同影响。预计本周人民币汇率维持区间波动格局，主要受美国通胀水平持续高企、我国进出口贸易顺差位于较高水平等因素综合影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.4600-6.5100。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点呈宽幅震荡的走势。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与前周持平，上周最高1589、最低1450，收于1558，波幅8.92%。
- 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35个点，上周最高

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。

6.6592、最低 6.6039，收于 6.6440，波幅 0.83%。

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	—	—	6.4705	-50	104	-544
银行间市场汇价	6.4798	6.4480	6.4678	-169	100	-720
掉期点						
1 个月期限	145	71	138	-1.5	3.3	8
2 个月期限	291	259	275	4	10	3
3 个月期限	442	416	421.5	-3.5	-7.5	36.5
6 个月期限	842	817	820	-11	11	80
1 年期限	1589	1450	1558	-12	-16	127

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	6.5101	6.4549	6.4898	-32	-364	82
2 个月期限	6.5231	6.4713	6.5062	-23	-320	109
3 个月期限	6.5396	6.4883	6.5232	-13	-280	132.5
6 个月期限	6.5792	6.5264	6.5658	-12	-212	160
1 年期限	6.6592	6.6039	6.6440	-35	-152	204

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。