

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年8月2日-8月6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（8月6日）报 6.4625，较前周贬值约 0.04%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.20%，上周最高 6.4562、最低 6.4880，收于 6.4688，波幅 0.49%。上周境内人民币汇率有所贬值，主要受进出口数据不及预期、美元指数震荡走强等因素共同影响。预计本周人民币汇率维持区间浮动，主要受银行间外汇市场供求力量趋于均衡、中美利差保持相对稳定等因素影响，人民币汇率交投区间将主要集中在 6.4500-6.5100。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投非常活跃，掉期点小幅下行，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下行 20 个点，上周最高 1605、最低 1565，收于 1590，波幅 2.52%。
- 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）较前周上行 242 个点，上周最高 6.6598、最低 6.6110，收于 6.6525，波幅 0.73%。

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	较前周 (点)	较上月 末(点)	较去年 末(点)
即期汇率						
中间价	—	—	6.4625	23	23	-624
银行间市场汇价	6.4880	6.4562	6.4688	128	128	-710
掉期点						
1 个月期限	144	123	132.50	0	0	2.50
2 个月期限	332.29	292	301.50	-9.50	-9.50	29.50
3 个月期限	430	0	421	0	0	36
6 个月期限	863	438	853	-22	-22	113
1 年期限	1605	1565	1590	-20	-20	159

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	6.4998	6.4566	6.4923	171	-339	102.50
2 个月期限	6.5148	6.4710	6.5074	241	-308	84.50
3 个月期限	6.5298	6.4870	6.5224	243	-288	115
6 个月期限	6.5763	6.5292	6.5689	117	-181	148
1 年期限	6.6598	6.6110	6.6525	242	-67	247

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。