

人民元週間レポート

2021年8月6日発行

みずほ銀行（中国）有限公司
中国為替資金部

Private and confidential

MIZUHO

【人民元為替概況】

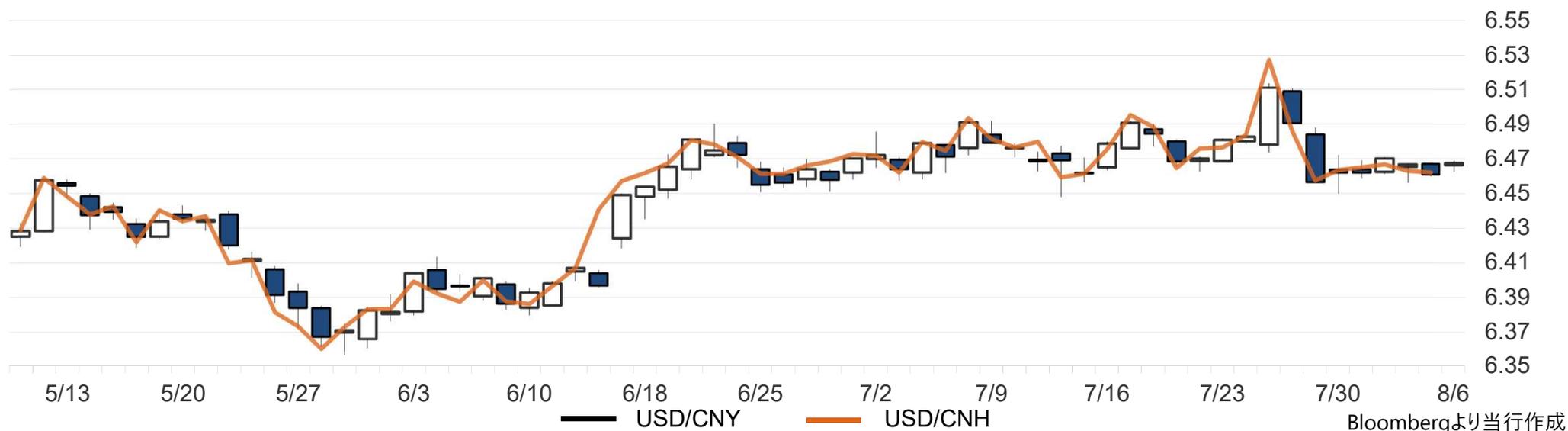
回顧： ドル人民元（USDCNY）は小幅な推移

- 2日、USDCNYは6.46台後半でオープン。3日夜、リスクオフのドル買いから6.47台へ上昇。4日夜、米ADP雇用統計の弱い結果を受けて6.45台後半まで下落した直後、クラリダFRB副議長の「利上げに必要な条件は22年末までに達成されるだろう」等の発言を受けて反発し、同日の下げを打ち消した。米雇用統計を控え様子見ムードが強く、週間を通して200pips以内の狭いレンジでの推移となった。

見通し： 指標結果が今後の相場の方向性を決めるかが焦点

- 中国では7日に貿易収支が、9日にはCPIの発表が控えている他、米国では6日に雇用統計が、11日にCPIの発表が控えている。米国の指標についてはFRBが金融政策を決めるにあたって重視する指標であり、レンジ推移が続いていたUSDCNYが一方向に動き出す可能性には警戒したい。
- 加えて、これまでのところ相場への影響は少ないが、中国国内で新型コロナウイルスの感染再拡大に関しても動向には引き続き留意しておきたい。

USD/CNY, USD/CNH Spot Rate



【マーケットデータ】

【USDCNY Daily】

DATE	OPEN	HIGH	LOW	CLOSE	PBOC FIXING
8/2	6.4640	6.4690	6.4590	6.4609	6.4660
8/3	6.4624	6.4708	6.4614	6.4649	6.4610
8/4	6.4652	6.4671	6.4562	6.4619	6.4655
8/5	6.4671	6.4671	6.4600	6.4611	6.4691
8/6	6.4664	6.4689	6.4626	6.4688	6.4625

【USDCNH Daily (Reference value from Bloomberg)】

DATE	OPEN	HIGH	LOW	CLOSE	Fixing*
8/2	6.4623	6.4726	6.4587	6.4650	6.4693
8/3	6.4650	6.4692	6.4603	6.4666	6.4660
8/4	6.4666	6.4674	6.4536	6.4630	6.4601
8/5	6.4630	6.4656	6.4544	6.4620	6.4622
8/6	6.4620	6.4675	6.4607	6.4673	6.4620

*CNH (HK) Fixing published at 11:15 A.M. by Hong Kong Treasury Markets Association

【SHIBOR FIXING(%)】

	8/2	LOW	HIGH	8/6
ON	1.8760	1.7090	~	1.8590
1M	2.3180	2.2780	~	2.2780
3M	2.4000	2.3680	~	2.3680
6M	2.5170	2.4890	~	2.4890
1Y	2.7800	2.7280	~	2.7280

【CNY MARKET Weekly】

	OPEN	HIGH	LOW	CLOSE
USD/CNY	6.4640	6.4708	6.4562	6.4688
100JPY/CNY	5.8906	5.9348	5.8826	5.8945
EUR/CNY	7.6674	7.6854	7.6408	7.6408
HKD/CNY	0.83187	0.83187	0.83020	0.83166
GBP/CNY	8.9802	9.0090	8.9759	9.0007

【MAJOR CURRENCY Weekly (Reference value from Bloomberg)】

	OPEN(TKY6:00)	HIGH	LOW	CLOSE
USD/JPY	109.69	109.89	108.72	109.77
EUR/USD	1.1869	1.1900	1.1811	1.1834
EUR/JPY	130.11	130.42	129.14	129.90
GBP/USD	1.3909	1.3958	1.3873	1.3931
AUD/USD	0.7344	0.7427	0.7329	0.7405

*Monday-Thursday

【USD LIBOR / JPY LIBOR(%)】

	USD Libor		JPY Libor	
	Rate (at Wed.)	Change (bp)*	Rate (at Wed.)	Change (bp)*
1M	0.0893	-0.1250	-0.0643	-0.0330
3M	0.1218	0.4000	-0.0992	0.3830
6M	0.1550	0.1870	-0.0640	0.2670
12M	0.2299	-0.5250	0.0530	0.1000

*Change from last Friday

Bloombergより当行作成

ご留意事項

・本資料に関するご照会先

- 当資料は情報提供のみを目的として作成したものであり、特定の取引の勧誘を目的としたものではありません。
- 当資料は信頼できると判断した情報に基づいて作成されていますが、その正確性、確実性を保証するものではありません。
- ここに記載された内容は事前連絡なしに変更されることもあります。
- 投資に関する最終決定は、お客様ご自身の判断でなさるようお願い申し上げます。
- また、当資料の著作権はみずほ銀行及びみずほ銀行（中国）に属し、その目的を問わず無断で引用または複製することを禁じます。

本資料に関するご照会先：

みずほ銀行（中国）有限公司 中国為替資金部 カスタマーチーム
(Tel:86-21-3855-8888)

Private and confidential

MIZUHO