

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年12月21日-12月25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（12月25日）报6.5333，较前周贬值约0.03%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.27%，上周最高6.5192、最低6.5566，收于6.5241，波幅0.57%。上周境内人民币汇率区间震荡，主要受国内经济持续复苏、美元指数小幅反弹等上下行因素共同影响。预计本周人民币汇率维持区间波动态势，主要受英国与欧盟达成脱欧协议、临近年末市场交投意愿降低、海外新冠病毒变异扩散等因素影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.5100-6.5700。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点整体窄幅震荡，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下行3个点，上周最高1520、最低1450，收于1502，波幅4.66%。
- 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99个点，上周最高6.7324、最低6.6487，收于6.6646，波幅1.26%。

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	—	—	6.5333	18	-449	-4429
银行间市场汇价	6.5566	6.5192	6.5241	-174	-586	-4421
掉期点						
1个月期限	166	109	155	3	-10.5	77
2个月期限	332	280	296	-2	-11	178
3个月期限	432.50	397	410	-5	-60	244
6个月期限	805	350	781	-9	-74	516
1年期限	1520	1450	1502	-3	-168	1044

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	6.5846	6.5223	6.5370	16	-4256	-26
2个月期限	6.5977	6.5285	6.5526	2	-4160	-11
3个月期限	6.6142	6.5410	6.5640	11	-4111	-11
6个月期限	6.6521	6.5775	6.5912	-12	-3993	-110
1年期限	6.7324	6.6487	6.6646	-99	-3624	-97

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。