

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年1月4日-1月8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（1月8日）报 6.4708，较前周升值约 0.84%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约 1.05%，上周最高 6.4292、最低 6.4780，收于 6.4719，波幅为 0.75%。上周境内人民币汇率震荡升值，主要受股票市场走势强劲吸引外资流入、海外疫情形势严峻压制美元等因素影响。预计本周人民币汇率继续维持高位区间波动态势，受近期美国大选尘埃落定、境外资金流入热情高涨、国内疫情零星散发等因素共同影响，预期人民币汇率将在 6.4500-6.5300 区间震荡。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点区间震荡，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 161 个点，上周最高 1440、最低 1235，收于 1270，波幅为 16.14%。
- 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 705 个点，上周最高 6.6620、最低 6.5420，收于 6.5887，波幅为 1.82%。

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	—	—	6.4708	-541	-541	-541
银行间市场汇价	6.4292	6.478	6.4719	-679	-679	-679
掉期点						
1 个月期限	187.7	100	145	15	15	15
2 个月期限	275	220	222.5	-49.5	-49.5	-49.5
3 个月期限	379	330	331	-54	-54	-54
6 个月期限	699	620	638	-102	-102	-102
1 年期限	1440	1235	1270	-161	-161	-161

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	6.5371	6.4327	6.4778	-484	-484	-86
2 个月期限	6.5413	6.4428	6.4885	-497	-497	-56
3 个月期限	6.5540	6.4534	6.4992	-520	-520	-58
6 个月期限	6.5951	6.4855	6.5243	-627	-627	-114
1 年期限	6.6620	6.5420	6.5887	-705	-705	-102

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。