

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年12月27日-12月31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31日）报6.3757，较前周贬值约0.10%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.05%，上周最高6.3400、最低6.3799，收于6.3730，波幅为0.63%。上周受美元指数下行、中美利差小幅收窄等因素交织影响，人民币对美元汇率区间震荡。预计人民币汇率区间波动，受结售汇市场整体偏向结汇、疫情在全球范围内再次蔓延等因素影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.3500-6.3800区间浮动。
- 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92.6个点，上周最高1556、最低1463，收于1495.4，波幅为5.86%。
- 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166个点，上周最高6.5531、最低6.4930，收于6.5169，波幅为0.92%。

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	—	—	6.3757	65	-37	-1492
银行间市场汇价	6.3400	6.3799	6.3730	30	82	-1668
掉期点						
1个月期限	217.52	0	189	19.5	-7	59
2个月期限	414	248.4	296	-44	-72	24
3个月期限	456	400	430	-30	-32	45
6个月期限	847	775	800	-48.01	-70.5	60
1年期限	1556	1463	1495.4	-92.6	-150.6	64.4

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	6.4068	6.3516	6.3759	-116	-1503	-160
2个月期限	6.4234	6.3637	6.3914	-116	-1468	-112
3个月期限	6.4369	6.3772	6.4044	-121	-1468	-116
6个月期限	6.4736	6.4169	6.4449	-136	-1421	-81
1年期限	6.5531	6.4930	6.5169	-166	-1423	-56.4

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。