

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年11月23日-11月27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（11月27日）报6.5755，较前周升值约0.05%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.17%，上周最高6.5510、最低6.5930，收于6.5823，波幅为0.64%。上周境内人民币汇率震荡贬值，主要受中国经济平稳复苏、部分多头获利了结等因素共同影响。预计本周人民币汇率区间宽幅震荡，交投区间主要集中在6.5400-6.6300。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点整体震荡下行，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70个点，上周最高1828、最低1729，收于1730，波幅为5.72%。
- 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190个点，上周最高6.7745、最低6.7029，收于6.7470，波幅为1.06%。

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 | — | — | 6.5755 | -31 | -1477 | -4007 |
| 银行间市场汇价 | 6.5930 | 6.5510 | 6.5823 | 109 | -1179 | -3839 |
| 掉期点 | | | | | | |
| 1个月期限 | 227 | 60 | 185 | 25 | 21 | 107 |
| 2个月期限 | 390 | 0 | 323 | -67 | -36 | 205 |
| 3个月期限 | 585 | 0 | 499 | -84 | -21 | 333 |
| 6个月期限 | 1003 | 905 | 911 | -82 | -19 | 646 |
| 1年期限 | 1828 | 1729 | 1730 | -70 | 50 | 1272 |

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 | 6.6305 | 6.5572 | 6.5888 | 185 | -3738 | -120 |
| 2个月期限 | 6.6332 | 6.5744 | 6.6065 | 208 | -3621 | -81 |
| 3个月期限 | 6.6492 | 6.5909 | 6.6210 | 175 | -3541 | -112 |
| 6个月期限 | 6.6935 | 6.6295 | 6.6580 | 152 | -3325 | -154 |
| 1年期限 | 6.7745 | 6.7029 | 6.7470 | 190 | -2800 | -83 |

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。