

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年12月28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：人民币中间价上周四（12月31日）报6.5249，较前周升值约0.13%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.24%，上周最高6.5148、最低6.5599，收于6.5398，波幅为0.69%。上周境内人民币汇率小幅贬值，受国内12月PMI数据低于前值、海外疫情形势严峻等因素共同影响。预计本周人民币汇率维持区间波动态势，交投区间主要集中在6.5000-6.5600。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点小幅震荡，截至上周四16:30，中长期限方面，1年期限美元对人民币掉期点较前周下行71个点，上周最高1580、最低1431，收于1431，波幅为10.41%。
- 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54个点，上周最高6.6865、最低6.6343，收于6.6592，波幅为0.78%。

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	-	-	6.5249	-84	-533	-4513
银行间市场汇价	6.5148	6.5599	6.5398	157	-429	-4264
掉期点						
1 个月期限	180	119	130	-25	-35.5	52
2 个月期限	325	270	272	-24	-35	154
3 个月期限	450	385	385	-25	-85	219
6 个月期限	825	740	740	-41	-115	475
1 年期限	1580	1431	1431	-71	-239	973

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	6.5549	6.5120	6.5262	-108	-4364	-266
2 个月期限	6.5670	6.5220	6.5382	-144	-4304	-288
3 个月期限	6.5779	6.5339	6.5512	-128	-4239	-271
6 个月期限	6.6220	6.5710	6.5870	-42	-4035	-268
1 年期限	6.6865	6.6343	6.6592	-54	-3678	-237

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。