

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年11月30日-12月4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4日）报6.5507，较前周升值约0.38%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.80%，上周最高6.5260、最低6.5950，收于6.5302，波幅为1.06%。上周境内人民币汇率有所上行，主要受美元指数走低、疫苗研发进展顺利提振市场风险偏好等因素影响。预计本周人民币汇率区间宽幅震荡，市场预期美国两党或将达成接近一万亿美元的财政刺激计划，美联储可能采取更为宽松的货币政策，美元指数跌破前期低位，人民币汇率预计短期内继续保持强势，人民币汇率交投区间将主要集中在6.5000-6.6000。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，掉期点震荡下行，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72个点，上周最高1710、最低1622，收于1660，波幅为5.30%。
- 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570个点，上周最

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。

高 6.7680、最低 6.6732，收于 6.6900，波幅为 1.42%。

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	-	-	6.5507	-248	-275	-4255
银行间市场汇价	6.5950	6.5260	6.5302	-521	-525	-4360
掉期点						
1 个月期限	195.88	42	157.50	-27.50	-8	79.50
2 个月期限	319	288	308	-15	1	190
3 个月期限	490	0	460	-39	-10	294
6 个月期限	888	243	861	-50	6	596
1 年期限	1710	1622	1660	-72	-10	1202

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	6.6247	6.5212	6.5365	-523	-4261	-94
2 个月期限	6.6332	6.5357	6.5510	-555	-4176	-100
3 个月期限	6.6496	6.5505	6.5650	-560	-4101	-112
6 个月期限	6.6894	6.5903	6.6085	-495	-3820	-78
1 年期限	6.7680	6.6732	6.6900	-570	-3370	-62

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。