

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2020年12月7日-12月11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11日）报6.5405，较前周升值约0.16%。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6.5198、最低6.5535，收于6.5411，波幅0.52%。上周境内人民币汇率震荡贬值，主要受出口数据表现较好、中美利差有所收窄、监管发声稳定汇率预期等因素影响。预计本周人民币汇率区间宽幅震荡，近期中美利差自前期高位小幅回落，市场供求力量趋于平衡，参与主体预期更加发散，人民币汇率升值速率有所放缓，人民币汇率交投区间将主要集中在6.5200-6.6000。
- 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132个点，上周最高1666、最低805，收于1528，波幅56.35%。
- 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78个点，上周最高6.7235、最低6.6525，收于6.6978，波幅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	-	-	6.5405	-102	-377	-4357
银行间市场汇价	6.5535	6.5198	6.5411	109	-416	-4251
掉期点						
1 个月期限	168	109	127.50	-30	-38	49.50
2 个月期限	309	150	297	-11	-10	179
3 个月期限	461	397	397	-63	-73	231
6 个月期限	862	700	770	-91	-85	505
1 年期限	1666	805	1528	-132	-142	1070

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	6.5799	6.5140	6.5579	214	-4047	40
2 个月期限	6.5927	6.5292	6.5698	188	-3988	-10
3 个月期限	6.6715	6.5382	6.5803	153	-3948	-5
6 个月期限	6.6479	6.5733	6.6183	98	-3722	2
1 年期限	6.7235	6.6525	6.6978	78	-3292	39

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。