

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年1月11日-1月15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（1月15日）报6.4633，较前周升值约0.12%。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6.4479、最低6.4962，收于6.4752，波幅为0.69%。上周境内人民币汇率震荡升值，主要受拜登政府宣布出台刺激政策带动美元明显走强等因素影响，人民币汇率有所贬值。预计本周人民币汇率维持高位区间波动，主要受近期美国将再度推出财政刺激计划、中国贸易顺差保持高位等因素共同影响。预期人民币汇率将在6.4500-6.5200区间震荡。
- 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上行68个点，上周最高1340、最低1190，收于1338，波幅为11.21%。
- 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226个点，上周最高6.623、最低6.5577，收于6.6113，波幅为0.99%。

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	—	—	6.4633	-75	-616	-616
银行间市场汇价	6.4479	6.4926	6.4752	33	-646	-646
掉期点						
1 个月期限	160	121	135.50	-9.50	5.50	5.50
2 个月期限	250	90	247	24.50	-25	-25
3 个月期限	366.50	310	358	27	-27	-27
6 个月期限	687	101	675	37	-65	-65
1 年期限	1340	1190	1338	68	-93	-93

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	6.5107	6.4448	6.4939	161	-323	51
2 个月期限	6.5325	6.464	6.5027	142	-355	28
3 个月期限	6.549	6.4748	6.5144	152	-368	34
6 个月期限	6.5867	6.5048	6.5472	229	-398	45
1 年期限	6.623	6.5577	6.6113	226	-479	23

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。