

# 工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年11月29日-12月3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3日）报6.3738，较前周升值约0.31%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周升值约0.29%，上周最高6.3596、最低6.3888，收于6.3728，波幅为0.46%。上周人民币对美元汇率小幅升值，主要受中美利差扩大等因素影响。预计本周人民币汇率区间浮动，受美联储可能加速缩减购债规模、结售汇市场供求总体均衡等因素综合影响，预计在岸人民币对美元汇率将在6.3500-6.4000区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投比较活跃，各期限掉期点震荡上行，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上行18个点，上周最高1674、最低1639，收于1670，波幅为2.12%。
- 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287个点，上周最高6.5709、最低6.5168，收于6.5357，波幅为0.83%。

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)
<b>即期汇率</b>						
中间价	—	—	6.3738	-198	-56	-1511
银行间市场汇价	6.3596	6.3888	6.3728	-185	27	-1670
<b>掉期点</b>						
1个月期限	233.39	184	187.26	44.76	-8.74	57.26
2个月期限	384.62	350	355	50.50	-13	83
3个月期限	491	455	481.50	19.50	19.50	96.50
6个月期限	883	859	878	14	7.5	138
1年期限	1674	1639	1670	18	24	239

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	6.4208	6.3640	6.3832	-272	-1430	-83.26
2个月期限	6.4338	6.3856	6.3997	-252	-1385	-86
3个月期限	6.4503	6.3991	6.4127	-282	-1385	-82.50
6个月期限	6.4889	6.4368	6.4562	-277	-1308	-44
1年期限	6.5709	6.5168	6.5357	-287	-1235	-41

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。