

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年12月6日-12月10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10日）报6.3702，较前周升值约0.06%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.02%，上周最高6.3418、最低6.3900，收于6.3704，波幅0.76%。上周境内人民币汇率小幅贬值，主要受人民银行上调外汇存款准备金率、美国通胀高增提振加快缩债预期等因素影响。预计本周人民币汇率区间震荡，主要受人民银行加强汇率调控、美国债务上限达成协议助推美元走强等因素综合影响，人民币汇率交投区间将主要集中在6.3400-6.3900。
- 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79个点，上周最高1663、最低1581，收于1594，波幅4.90%。
- 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40个点，上周最高6.5658、最低6.4878，收于6.5429，波幅1.19%。

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	—	—	6.3702	-36	-92	-1547
银行间市场汇价	6.3900	6.3418	6.3704	14	56	-1694
掉期点						
1 个月期限	193.8	164.20	171.30	-15.96	-24.70	41.30
2 个月期限	355.11	330	331	-24	-37	59
3 个月期限	474.50	448	449	-32.50	-13	64
6 个月期限	880	838	841.88	-36.12	-28.62	101.88
1 年期限	1663	1581	1594	-79	-52	163

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	6.4090	6.3378	6.3909	30	-1353	33.70
2 个月期限	6.4233	6.3537	6.4059	25	-1323	24
3 个月期限	6.4377	6.3670	6.4204	25	-1308	51
6 个月期限	6.4826	6.4064	6.4619	-10	-1251	73.12
1 年期限	6.5658	6.4878	6.5429	-40	-1163	131

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。