

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年12月13日-12月17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17日）报6.3651，较前周升值约0.08%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约0.06%，上周最高6.3580、最低6.3837，收于6.3742，波幅0.40%。上周境内人民币汇率小幅贬值，主要受中央明年政策定调积极、美联储加快缩减购债等上下行因素共同影响。预计本周人民币汇率区间浮动，主要受人民银行加强汇率调控、市场逐渐消化美联储加息预期等因素影响，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，掉期点小幅上行，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2个点，上周最高1610、最低1566，收于1596，波幅2.76%。
- 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89个点，上周最高6.5602、最低6.5135，收于6.5518，波幅0.71%。

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	—	—	6.3651	-51	-143	-1598
银行间市场汇价	6.3580	6.3837	6.3742	38	94	-1656
掉期点						
1 个月期限	203.50	137.52	173.50	2.20	-22.50	43.50
2 个月期限	340	322.50	339	8	-29	67
3 个月期限	464	435	450	1	-12	65
6 个月期限	856	825	855	13.12	-15.50	115
1 年期限	1610	1566	1596	2	-50	165

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	6.4132	6.3690	6.4038	129	-1224	122.50
2 个月期限	6.4287	6.3830	6.4193	134	-1189	112
3 个月期限	6.4417	6.3959	6.4326	122	-1186	134
6 个月期限	6.4827	6.4346	6.4738	119	-1132	141
1 年期限	6.5602	6.5135	6.5518	89	-1074	180

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。